



# SEB Sverige Indexfond

## Informationsbroschyr

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. Fondandelar och andra finansiella instrument kan både stiga och falla i värde och det är inte säkert att du får tillbaka investerat kapital.

---

Informationsbroschyren är upprättad i enlighet med lagen (2004:46) om värdepappersfonder och Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2013:9) om värdepappersfonder.



SEB

# 1. Allmän information

---

Denna informationsbroschyr avser SEB Sverige Indexfond ("Fonden"). Fonden är en värdepappersfond enligt lagen (2004:46) om värdepappersfonder.

SEB Investment Management AB ("Bolaget") förvaltar inom ramen för sin fondverksamhet både värdepappersfonder och alternativa investeringsfonder. I informationsbroschyren ingår följande delar:

1. Allmän information
2. Placeringsinriktning och riskinformation
3. Historisk avkastning
4. Information om Bolaget
5. Fondbestämmelser

Information om fondens miljörelaterade och/eller sociala egenskaper finns i bilagan till informationsbroschyren.

## Fondens rättsliga karaktär

En fond bildas genom kapitaltillskott från allmänheten, eller en avgränsad krets investerare, och fondens förmögenhet ägs av dem som har tillskjutit kapital. Fonden förvaltas av ett fondbolag, som företräder fondandelsägarna i alla frågor som rör fonden. Tillgångarna förvaras av ett förvaringsinstitut.

Fonden är inte en juridisk person. Detta innebär bland annat att den inte kan förvärva rättigheter eller ta på sig skyldigheter. Egendom som ingår i en fond kan inte utmätas.

En fondandel är en rätt till så stor andel av fonden som motsvarar dess nettoförmögenhet dividerad med antalet utestående andelar. En fondandel kan inlösas, överlätas och pantsättas.

Samtliga andelsägare behandlas lika och ingen förmånsbehandling av andelsägare tillämpas av Bolaget.

## Andelsklasser

Fonden har två andelsklasser och andelarna i varje andelsklass medför lika rätt till den egendom som ingår i fonden.

- A) Utdelande andelsklass med lägsta belopp vid första teckning av andelar 5 000 000 kronor och
- B) Icke utdelande andelsklass

Bolaget får en gång per år fatta beslut om utdelning till andelsägarna. Utdelning till andelsägarna från Fonden sker i maj månad året efter räkenskapsåret. Utdelningen beräknas i enlighet med Bolagets allmänna utdelningsmetod och beräknas exempelvis över de senaste tre årens värde för att dela ut ett jämnare belopp. Målsättningen är att Fonden årligen ska dela ut mellan 3 och 4 procent av detta värde. Fullständig information kring Fondens utdelning återfinns i fondbestämmelserna under § 12.

## Andelsägarregister

Bank of New York Mellon, nedan BNYM, för register över alla andelsägare och panthavare. Fondförsäkringsbolag och pensionssparinstitut för egna register över hur försäkringstagarnas och pensionsspararnas premier placerats i olika fonder.

## Försäljning och inlösen av fondandelar

Fonden är normalt öppen för försäljning (köporder) och inlösen (säljorder) varje svensk bankdag, dock inte sådana bankdagar då värdering av fondens tillgångar inte kan göras på ett sätt som säkerställer fondandelsägarnas lika rätt, till exempel till följd av att en eller flera av de marknader som fondens handel sker på är helt eller delvis stängda.

Bolaget har rätt att senarelägga försäljning och inlösen av andelar i fonden, om det finns särskilda skäl för åtgärden och det är motiverat med hänsyn till fondandelsägarnas intresse. Begäran om försäljning eller inlösen som kommer Bolaget tillhanda under denna tid ska verkställas i den ordning de inkommit till den kurs som fastställs första bankdagen efter det att sådan omständighet inte längre föreligger.

Handel med fondandelar sker över fondkonto eller depå i SEB eller på sätt som framgår av Bolagets hemsida, [www.seb.se/fondbolaget](http://www.seb.se/fondbolaget). Regler för fondkonto samt bestämmelser för depå finns att få hos SEBs samtliga kontor.

Begäran om försäljning och inlösen av fondandelar kan lämnas genom SEB eller på sätt som framgår av Bolagets hemsida, [www.seb.se/fondbolaget](http://www.seb.se/fondbolaget). Försäljning och inlösen av andelar verkställs normalt bankdagen efter den bankdag som begäran lämnas, om registrering av begäran kan ske före kl. 15.30. Observera att begäran om försäljning och inlösen av fondandelar genom SEB AB måste lämnas före kl. 13.30 och genom

SEB Pension & Försäkring före kl. 13.00, för att registrering av begäran ska kunna ske före kl. 15.30. Vissa distributörer av fonden kan tillämpa andra tider för när begäran senast ska lämnas. Verkställighet sker till den kurs som avser bankdagen då begäran lämnas. Om begäran lämnas senare verkställs försäljning och inlösen normalt påföljande bankdag.

Före vissa helgdagar stänger SEBs system tidigare, vilket innebär att begäran och registrering ska ske före ett tidigare klockslag. Information om detta finns att få på bankkontoren och Internetkontoret den aktuella dagen. Om begäran inte kan registreras i angiven tid, verkställs försäljning och inlösen normalt påföljande bankdag under samma förutsättningar som angivits ovan.

Om det vid begäran om inlösen inte finns medel tillgängliga i Fonden ska medel anskaffas genom försäljning av Fondens egendom, och inlösen verkställas så snart det är möjligt.

Det är inte möjligt att limitera en begäran om försäljning och inlösen av fondandelar. Begäran om försäljning respektive inlösen av fondandelar får återkallas endast om Bolaget medger det.

Försäljning och inlösen av fondandelar sker alltid till okänd kurs. Fastställd och korrekt handelskurs meddelas påföljande dag.

För andelsklass A är lägsta belopp vid första teckning av andelar 5 000 000 kronor.

För andelsklass B finns inget krav på minsta belopp vid första teckning av andelar.

Bolaget har begränsade möjligheter att erbjuda tjänster till kunder som är bosatta, permanent eller tillfälligt, i vissa län-

## Allmän information, forts

der, till exempel USA. Därför förbehåller sig Bolaget rätten att avstå från att sälja fondandelar till personer bosatta i vissa länder och juridiska personer med säte i vissa länder till exempel om det skulle kunna strida mot gällande författningar i sådana länder. Detta finns mer utförligt beskrivet i fondbestämmelserna under § 17 och ytterligare information kan fås av SEB.

### Fondens målgrupp

Fonden lämpar sig främst för sparare som har en placeringshorisont på minst 5 år. Fondspararen måste kunna acceptera att stora kurssvängningar kan förekomma.

### Avgifter

Ur Fondens medel ska ersättning betalas till Bolaget för Fondens förvaltning. Ersättningen inkluderar kostnader för förvaring, tillsyn och revisorer ("Förvaltningsavgift"). Denna avgift är bestämd i förväg och uttrycks i procent per år.

Uppgift om storleken på den Förvaltningsavgift som betalats av Fonden för föregående år finns i dess årsberättelser. Uppgift om andelsägarens andel av de sammanlagda kostnaderna lämnas på årsbeskedet.

I Fondens faktablad används begreppet löpande kostnader som utgörs av två poster;

- Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader

- Transaktionskostnader.

Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader utgör summan av de faktiska kostnaderna för fonden under det senaste året, både engångskostnader samt löpande kostnader. Här ingår underliggande fonders löpande kostnader, deras eventuella resultatrelaterade avgifter samt transaktionskostnader.

Transaktionskostnader är en uppskattning av kostnaderna som uppstår när Bolaget köper och säljer fondens underliggande investeringar. Här ingår fondens direkta transaktionskostnader, som exempelvis courtage och skatter, men även fondens indirekta transaktionskostnader, som exempelvis spreadkostnader, det vill säga skillnaden mellan finansiella instruments uppskattade marknadsvärde och det pris som någon får köpa/sälja dem för under en handelsdag.

I Fondens faktablad redovisas även fondens resultatrelaterade avgifter.

#### Avgifter i SEB fonder

Om fonden investerar i andra fonder med SEB i namnet, kompenseras fonden för förvaltningsavgiften i den underliggande SEB-fonden.

#### Avgifter i externa fonder

Om fonden investerar i fonder som förvaltas av fondbolag utanför SEB-Gruppen (externa fonder), belastas fonden med den fasta förvaltningsavgiften i den underliggande externa fonden. Eventuell erhållen rabatt på den fasta förvaltningsavgiften tillfaller fonden och därmed dess andelsägare. Fonden

belastas även av eventuell prestationsbaserad förvaltningsavgift.

Vid pantsättning av andelar utgår för närvarande ingen avgift för registreringen.

#### Övriga kostnader

Eventuella skattekostnader som uppstår vid till exempel utdelningar på Fondens innehav ska belasta Fonden.

Såväl Förvaltningsavgiften som övriga kostnader är avdragna när Fondens kurs och värdeutveckling visas.

### Högsta och gällande avgifter

Avgiftsuttaget regleras i fondbestämmelserna, där det framgår vilka avgifter som får tas ut i Fonden och vad de som högst får uppgå till.

#### Gällande avgifter

Nedan följer en sammanställning av gällande avgifter för Fonden.

*Insättningsavgift:* 0 %

*Uttagsavgift:* 0 %

*Årlig förvaltningsavgift för andelsklass A:* 0,25 % av Fondens värde.

*Årlig förvaltningsavgift för andelsklass B:* 0,4 % av Fondens värde.

#### Högsta avgifter

Nedan följer en sammanställning av högsta tillåtna fasta avgifter för Fonden.

*Insättningsavgift:* 0%

*Uttagsavgift:* 0 %

*Årlig förvaltningsavgift för andelsklass A:* 0,25 % av Fondens värde.

*Årlig förvaltningsavgift för andelsklass B:* 0,4 % av Fondens värde.

### Fondens mål, förvaltningsstrategi och jämförelseindex

Fonden har som mål att generera en avkastning och riskprofil som ligger i linje med sitt jämförelseindex, frånsett de exkluderingsåtgärder som görs utifrån fondbolagets hållbarhetspolicy.

Fonden är passivt förvaltd och investerar främst i aktier på den svenska marknaden. Fondens jämförelseindex är ett återinvestering aktieindex som består av alla bolag noterade på Stockholmsbörsen exklusive de bolag som inte uppfyller särskilda hållbarhetskriterier.

Fondens utveckling jämförs med SIX Sweden Sustainability Index Gross Index (SIXSESUSTAINGI). Fondens jämförelseindex bedöms vara relevant för fonden eftersom det ger en god representation av fondens långsiktiga investeringsinriktning med avseende på val av aktier, bolagens storlek och geografisk marknad som fonden investerar i.

## Allmän information, forts

### Aktivitetsgrad

Fondens aktivitetsgrad beskrivs med hjälp av aktivitetsmättet aktiv risk (tracking error), som visar hur mycket differensen mellan fondens respektive jämförelseindexets avkastning varierat över tid. Aktivitetsgraden redovisas i procent och beräknas som standardavvikelsen (den genomsnittliga avvikelser från medelavvikelsen) för differensen mellan fondens och jämförelseindexets avkastning. Ju högre aktivitetsgrad fonden uppvisar desto större är den genomsnittliga avvikelsen. Beräkningen tar inte hänsyn till om avvikelsen är positiv eller negativ.

Nedan visas uppnådd historisk aktivitetsgrad i Fonden för de senaste tio kalenderåren, eller, om Fonden funnits kortare tid än 10 år men mer än två år, så många hela år som Fonden funnits. Beräkningen av aktiv risk baseras på månadsdata från de två senaste kalenderåren.

ÅR	Aktiv risk (A)	Aktiv risk (B)
2014	0,1%	-
2015	0,1%	-
2016	0,1%	-
2017	0,1%	-
2018	0,1%	0,1%
2019	0,1%	0,1%
2020	0,1%	0,1%
2021	0,1%	0,1%
2022	0,1%	0,1%
2023	0,2%	0,2%

Fonden är en indexfond där förvaltningen fokuserar på att hålla en låg aktiv risk över tid jämfört med fondens jämförelseindex. Under de senaste fem åren har fonden realiserat en aktiv risk runt 0,1 procent, vilket är i den nedre delen av det långsiktiga målintervallet. Det innebär att den aktiva risken är i linje med förväntningarna. De senaste åren har marknadens volatilitet varierat på grund av pandemin, energikrisen samt kriget i Ukraina. 2023 präglades i stort av inflation och räntehöjningar såväl i Sverige som globalt. Fondens aktiva risk har trots detta realiserats inom den nedre delen av målintervallet även om den ökat marginellt. Aktiv andel (active share) har varit under 1 procent de senaste fyra åren.

### Uppdragsavtal/Primärmäklare

Bolaget har uppdragit åt Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ) ("SEB") att ansvara för delar av Bolagets fondadministration m.m. Det innebär bland annat att SEB ska tillhandahålla Bolaget en funktion för internrevision, klagomålshantering samt sköta Bolagets redovisning. Bolaget har även uppdragit åt SEB att sköta IT-driften, systemförvaltning och HR. Bolaget har även uppdragsavtal med BNYM att hantera delar av Bolagets fondadministration samt föra fondandelsägarregistret. Vidare har Bolaget ett distributionsavtal med SEB Asset Management AB såsom Bolagets globala distributör.

### Förvaringsinstitut

Fondens förvaringsinstitut ("Institut") är Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ) ("SEB"), och dess rättsliga form är Bankaktiebolag (ett aktiebolag som fått tillstånd att bedriva bankrörelse). SEBs huvudsakliga verksamhet är bank- och finansiell verksamhet och dess säte är beläget i Stockholm.

Institutets huvudsakliga verksamhet är att förvara Fondens tillgångar och verkställa Bolagets beslut avseende Fonden. Institutet ska dessutom kontrollera att Bolagets instruktioner avseende förvaltningsbeslut för fonderna inte strider mot bestämmelser i lag, föreskrifter eller fondbestämmelserna. Institutet ska handla hederligt, rättvist, oberoende och professionellt samt utslutande i Fondens och andelsägarnas gemensamma intresse.

SEB AB har uppdragit åt Brown Brother Harriman & Co (BBH) att agera sammanhållande för värdepapper som förvaras utanför Sverige. BBH har delegerat förvaringen av vissa värdepapper till bolag inom dess nätverk av depåbanker.

### Hantering av intressekonflikter

SEB har rutiner för att kunna identifiera, hantera, övervaka och redovisa eventuella intressekonflikter. Eftersom Institutet är en del av SEB kan intressekonflikter uppstå mellan Institutets verksamhet och andra verksamheter inom SEB. För att potentiella intressekonflikter inte ska påverka fonderna och dess andelsägare negativt är Institutet och övriga verksamheter inom SEB samt Bolagets verksamhet funktionellt och organisatoriskt åtskilda. Institutet agerar fristående från fonderna och Bolaget och utslutande i andelsägarnas intresse. Områden där intressekonflikter kan uppstå är till exempel mellan tjänsten som utgör handel med finansiella instrument för egen och kunders räkning och investeringsrådgivning, samt mellan kunderna för dessa verksamheter. Då Bolaget och Institutet tillhör samma koncern kan det även utlösa intressekonflikter såsom styrning och prioriteringar i koncernen. Uppdaterad information om Institutet samt en beskrivning av dess uppgifter och de intressekonflikter som kan uppstå kan erhållas från Bolaget.

Institutet kan delegera delar av verksamheten till ett eller flera externa bolag, däribland andra depåbanker som utses av Institutet från tid till annan. De uppgifter som får delegeras, enligt UCITS-direktivet och tillämplig svensk reglering, är förvaring och förteckning. Institutet ska handla med vederbörlig skicklighet, aktsamhet och omsorg vid sitt val, fortsatta engagerande och övervakning av den part till vilken förvaringsinstitutetsfunktioner har delegerats. En lista över uppdragstagare och uppdragstagare till vilka vidaredelegering skett och eventuella intressekonflikter som kan uppstå till följd av sådan delegering kan erhållas från Bolaget.

### Helårsberättelser och halvårsredogörelser

För förvaltade fonder sammanställs fonddrapporter, d v s helårsberättelser och halvårsredogörelser. Dessa finns att tillgå på SEBs hemsida [www.seb.se/fonder](http://www.seb.se/fonder). Om du så begär kan du som andelsägare få en sådan rapport hemskickad.

## Allmän information, forts

---

### Revisorer

Revisorerna har till uppgift att granska räkenskaperna som ligger till grund för Fondens årsberättelse. Uppgift om revisionsbolag och utsedda revisorer finns under avsnittet kallat information om Bolaget.

### Ändringar av fondbestämmelser

Bolaget har möjlighet att ändra Fondens fondbestämmelser genom att ansöka om detta hos Finansinspektionen. Ändringarna kan påverka Fondens egenskaper, till exempel dess investeringspolicy, avgifter och riskprofil. Sedan ändring godkänts ska beslutet hållas tillgängligt hos Bolaget och förvaringsinstitutet samt tillkännages på det sätt Finansinspektionen anvisar.

### Skatteregler

#### Fondens beskattning:

Sedan den 1 januari 2012 är svenska värdepappersfonder och specialfonder inte skattskyldiga för inkomsterna i fonden. Beskattningen i fonden har ersatts av en schablonskatt som tas ut av andelsägarna.

#### Fondspararens skatt (fysisk person och dödsbo skattskyldig i Sverige):

Sedan den 1 januari 2012 schablonbeskattas svenska fondandelsägare årligen för sitt fondbesittande. Underlaget för schablonskatten utgörs av värdet på andelsägarens fondbesittande vid ingången av beskattningsåret. På värdet av fondandelarna beräknas en schablonintäkt som utgörs av 0,4 procent av underlaget. Schablonintäkten tas sedan upp i inkomstslaget kapital och beskattas med 30 procent. Det motsvarar en beskattning på 0,12 procent av fondandelarnas värde. Den årliga schablonintäkten redovisas på kontrolluppgift till Skatteverket, men det sker inget avdrag för preliminär skatt.

Om Fonden lämnar utdelning beskattas andelsägaren för utdelningen med 30 procent. Vid utdelningen dras 30 procent preliminärskatt och utdelningsbeloppet redovisas på kontrolluppgift till Skatteverket. Det framgår av § 12 i fondbestämmelserna om Fonden lämnar utdelning.

Vid avyttring/inlösen av fondandelar beskattas en kapitalvinst med en skattesats på 30 procent, medan en kapitalförlust får dras av. Vinsten eller förlusten ska redovisas som inkomst av kapital. Kapitalvinster och kapitalförluster vid inlösen/avyttring av fondandelar redovisas på kontrolluppgift till Skatteverket, men inget skatteavdrag görs.

Om fonden är knuten till investeringssparkonto, fondförsäkring, IPS eller premiepension gäller särskilda skatteregler. Även för juridiska personer och fondandelsägare bosatta i utlandet gäller särskilda regler.

Beskattningen kan påverkas av individuella omständigheter. Den som är osäker på eventuella skattekonsekvenser bör söka experthjälp.

### Skadeståndsansvar

För det fall skada tillfogas andelsägarna genom att Bolaget eller förvaringsinstitutet överträtt lagen om värdepappersfon-

der eller fondens fondbestämmelser finns bestämmelser i 2 kap. 21 § respektive 3 kap. 14 - 16, lagen om värdepappersfonder.

Bolaget eller förvaringsinstitutet ansvarar inte för skada som beror på omständigheter utanför Bolagets eller förvaringsinstitutets kontroll, t.ex. extraordinära händelser såsom strejk eller krigshändelse. Indirekt skada som uppkommer i andra fall ska endast ersättas om grov vårdslöshet förelegat eller för andra skador om inte Bolaget eller förvaringsinstitutet har varit normalt aktsamt. Bolagets respektive förvaringsinstitutets ansvarsbegränsning finns mer utförligt beskriven i fondbestämmelserna under § 16.

### Fondens upphörande eller överlåtelse av fondverksamheten

Bolaget får besluta att Fonden ska upphöra, läggas samman med en annan fond, eller att Fondens förvaltning, efter medgivande av Finansinspektionen, överläts till annat fondbolag. Ett överlåtande får ske tidigast tre månader efter det att förändringarna kungjorts, om inte Finansinspektionen givit tillstånd att låta fonden överlåtas tidigare.

Om Bolaget beslutat att förvaltningen ska upphöra ska förvaltningen av Fonden tas över av förvaringsinstitutet. Detsamma gäller om Finansinspektionen återkallar Bolagets tillstånd eller om Bolaget trätt i likvidation eller försatts i konkurs.

Bolaget kan slå samman eller dela fonder, om Finansinspektionen ger sitt tillstånd till detta. Fonder får slås samman eller delas tidigast tre månader efter det att Finansinspektionen har fattat sitt beslut.

Förändringar av detta slag ska, om Finansinspektionen inte medger undantag, kungöras i Post- och Inrikes Tidningar och det ska finnas information om förändringarna tillgängligt hos både Bolaget och förvaringsinstitutet, samt tillkännages på det sätt Finansinspektionen anvisar.



## 2. Placeringsinriktning och riskinformation

### Placeringsinriktning

Fonden är en indexfond som syftar till att efterlikna utvecklingen av SIX Sweden Sustainability Index Gross Index (SIX-SESUSTAINGI) och därigenom uppnå en värdetillväxt som i stort motsvarar utvecklingen av detta index. Fonden använder sig av en fysisk replikeringsstrategi som innebär att den placerar direkt i de aktier som ingår i indexet. Faktorer som kan påverka Fondens förmåga att följa sitt index inkluderar bland annat (i) skatter, (ii) transaktionskostnader såsom courtage och notakostnader, (iii) illikvida värdepapper, (iv) återinvestering av utdelningar, (v) olika typer av justeringar i index som inte går att replikera. Hur ofta index rebalanseras har en kostnadspåverkan på Fonden, då Fonden anpassar sig till dessa förändringar. Om index rebalanseras mer frekvent kan det innebära ökade kostnader för Fonden. Den har Finansinspektionens tillstånd enligt 5 kap. 7 § lagen om värdepappersfonder.

SIXSESUSTAINGI är ett index som består av samtliga bolag noterade på Stockholmsbörsen, exklusive de bolag som inte följer indexets sociala, miljömässiga samt etiska kriterier. Bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer och standarder gällande miljö, mänskliga rättigheter, arbete och korruption eller är involverade i kontroversiella vapen exkluderas. Krav på hållbarhet omfattar ett speciellt fokus på bolag med involvering i fossila bränslen såsom kol, olja och gas där en generell exkludering gäller för bolag som är involverade i aktiviteter kopplade till produktion, utvinning eller bearbetning av fossila bränslen. Indexet exkluderar vidare företag med en omsättning över 5 procent generellt kopplat till aktiviteter inom alkohol, kommersiella spel, tobak, pornografi eller militärutrustning. Det är ett marknadsvärdesviktat index som tar hänsyn till den totala avkastning (brutto) som aktieägarna erhåller i form av utdelning. Antalet bolag varierar över tiden. Indexet omdefinieras kontinuerligt både vad gäller ingående överlåtbara värdepapper och deras procentuella andel av index. På grund av omdefiniering av index, emissioner samt andra specifika händelser kan fonden under en begränsad tid komma att innehålla överlåtbara värdepapper eller derivatinstrument som inte ingår i SIXSESUSTAINGI. Indexet samäggs av SIX Financial Information och ISS-Ethix och beräknas av SIX medan analysen och urvalet av de bolag som exkluderas från index utförs av ISS-Ethix. För detaljerad information om detta index såsom underliggande komponenter, vikter, beräkningsmetod och hur ofta det rebalanseras se websidan: [www.sebgroup.lu/informationomindex](http://www.sebgroup.lu/informationomindex).

Sedan den 1 januari 2018 gäller nya EU-regler vilka innebär att en administratör som kontrollerar tillhandahållandet av ett referensvärde måste godkännas och registreras hos ESMA senast den 1 januari 2020. Fondens index tillhandahålls av en administratör som har registrerats hos ESMA.

Fondbolaget har upprättat en plan för det fall administratören skulle upphöra att tillhandahålla SIXSESUSTAINGI eller SIXSESUSTAINGI ändras väsentligt. Fondbolaget kommer då att försöka hitta ett motsvarande index och byta till detta. Fondbestämmelserna kommer som en följd av detta att behöva ändras samt godkännas av Finansinspektionen och andelsägarna kommer att informeras. Andelsägarna skyddas genom den prövning av ändrade fondbestämmelser som görs av Finansinspektionen.

Fondens medel får placeras i överlåtbara värdepapper, penningmarknadsinstrument, derivatinstrument och på konto hos kreditinstitut samt högst 10 procent av dess värde i andra fonder eller fondföretag. I Fonden får även ingå de likvida medel som behövs för Fondens förvaltning. Fonden får placera i överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som avses i 5 kap. 5 § lagen om värdepappersfonder.

Tracking error under normala marknadsförhållanden, mätt som "ex ante", förväntas inte överstiga 0,3 procent. Tracking error är ett mått på hur nära en portfölj följer det index med vilket det jämförs.

Derivatinstrument får användas som ett led i placeringsinriktningen. Fonden får även använda OTC-derivat. Vid placering i derivatinstrument ska underliggande tillgångar utgöras av eller hänföra sig till sådana tillgångar som avses i 5 kap. 12 § lagen om värdepappersfonder.

Förvaltaren kan använda sig av tekniker för effektiviserad värdepappersförvaltning, exempelvis repor, i syfte att öka avkastningen.

Fonden använder för närvarande inte värdepappersfinansieringstransaktioner i den mening som avses i Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2015/2365 av den 25 november 2015. Om Fonden ingår sådana transaktioner kommer fondens informationsbroschyr att uppdateras.

### Säkerhetsshantering

Om Fonden gör transaktioner med finansiella OTC-derivat och använder sig av tekniker för effektiviserad värdepappersförvaltning, ska Fonden, vid varje tidpunkt, följa Bolagets säkerhetsinstruktion, i enlighet med ESMA:s riktlinjer (ESMA/2014/937).

Godtagbara säkerheter enligt Bolagets säkerhetsinstruktion ska, om de inte utgörs av likvida medel, utmärkas av hög likviditet, kunna värderas dagligen, vara utgivna av en utgivare med hög kreditvärdighet samt vara diversifierade.

För varje typ av tillgång tillämpas en lämplig nedskrivningsstrategi (haircut policy) beroende på tillgångens kreditvärdighet, volatilitet och löptid.

Säkerheter som inte utgörs av likvida medel får varken säljas, återinvesteras eller pantsättas. Dess marknadsvärde ska, efter tillämpad nedskrivningsstrategi, vara minst 100 procent av motpartens exponeringsvärde.

Fonden har möjlighet att realisera mottagna säkerheter vid varje tidpunkt utan godkännande från motparten.

### Allmän riskinformation

Sparande i fonder är förenat med risk. Med risk i placerings-sammanhang avses osäker avkastning. Det som vanligtvis avses med en fonds risk är hur mycket fonden förändrats i värde över tid. Placeringar i fonder kan bland annat innebära risker kopplade till aktie-, obligations-, och valutamarknaderna exempelvis i form av förändringar i priser, räntor och kreditvärdighet m.m. Några av dessa riskfaktorer presenteras kortfattat nedan.

## Placeringsinriktning och riskinformation, forts

---

En fond innehåller ofta placeringar i eller exponering mot tillgångsslagen aktier, obligationer och valutor. Aktier är generellt sett förknippade med en högre risk än obligationer och valutor. Risk och möjlighet till högre avkastning hänger samman. En sparare behöver ta någon form av risk för att kunna få ersättning i form av högre avkastning. Ofta kan en kombination av placeringar i olika tillgångsslag erbjuda den enskilde spararen önskad riskspridning.

Värdet på en fond bestäms av värdeförändringarna på de tillgångar som fonden placerat i. Det innebär att fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta kapitalet.

### Olika typer av risker

#### Marknadsrisk

Med marknadsrisk avses de makroekonomiska prisriskerna som finns på marknaden, t.ex. förändringar i priset på räntebärande instrument, aktier, valutor och råvaror. Investeringar har olika känslighet för olika marknadsrisker varför deras pris varierar i olika grad. Marknadsrisken har stor påverkan på investeringens värde.

#### Ränterisk

Beskriver känsligheten för förändrade marknadsräntor hos ett räntebärande instrument och uttrycks vanligen i procent. Risken i räntefonder påverkas bland annat av vilken duration, d.v.s. genomsnittlig löptid justerat för räntebetalningar, fondens innehav har samt det rådande läget på räntemarknaden. Sjunkande räntor ökar värdet på en fonds innehav av räntebärande instrument och omvänt medför stigande räntor att värdet på innehaven minskar. Räntefonder som placerar i räntebärande instrument med längre löptider är utsatta för en högre risk, eftersom marknadsvärdet riskerar att påverkas mer av ränteförändringar.

#### Landrisk/geografisk risk

Placeringar på en begränsad geografisk marknad, t.ex. ett enskilt land eller ett fåtal länder/marknader, kan innebära högre risk än placeringar med bredare spridning på grund av en högre grad av koncentration, lägre marknadslikviditet eller större känslighet för förändringar i marknadsvillkoren. För en fond som placerar tillgångarna helt eller delvis i aktier och på en begränsad geografisk marknad finns oftast marknadsrelaterade begränsningar. Möjligheterna att placera fondens tillgångar på ett sätt som väsentligt avviker från den marknad som fonden placerar i kan därför vara begränsad i varierande grad. Placeringar i tillväxtmarknader uppvisar ofta större variationer i tillgångspriser än placeringar i mer mogna marknader. Placeringar i tillväxtmarknader kan även påverkas av faktorer som låg likviditet på lokala marknader, ekonomisk instabilitet samt stora valutakursförändringar etc. Många tillväxtmarknader är relativt unga och har ofta en politisk risk som är högre än i mer utvecklade marknader. De kan därför vara känsliga för yttre och inre påverkan av olika slag och det finns risker för militära, sociala, etniska och religiösa konflikter som kan påverka såväl den politiska som ekonomiska utvecklingen i länderna. Det förekommer även brister i lagstiftning eller brister i förvar av finansiella instrument.

#### Koncentrationsrisk

Fonder som placerar i ett begränsat segment eller i viss bransch, eller ett fåtal emittenter, har normalt en högre koncentrationsrisk än fonder som sprider riskerna genom att placera mer diversifierat. Fonder måste enligt lag sprida risken genom att investera i instrument utgivna av flera olika emittenter. För en fond som placerar tillgångarna helt eller delvis i aktier och i ett specifikt segment av en marknad, kan koncentrationsrisken vara betydande. Möjligheterna att placera fondens tillgångar på ett sätt som väsentligt avviker från den marknad som fonden placerar i kan därför vara begränsad i varierande grad.

#### Korrelation & samvarians

För fonder som placerar i flera tillgångsslag, till exempel så kallade blandfonder, där värdeförändringar i de olika tillgångsslagen går åt olika håll vid marknadsrörelser, gäller i normalfallet att tillgångsslagen totalt sett har en låg intern korrelation/samvarians. Detta medför en lägre total risk för en sådan fond eftersom värdeförändringarna i de olika tillgångsslagen till viss del tar ut varandra. Av samma orsak har en fond där de olika tillgångsslagens värdeförändringar rör sig i samma riktning vid marknadsrörelser en hög intern korrelation/samvarians och fondens totala risk blir därför normalt sett högre.

#### Kreditrisk

Obligationer eller andra räntebärande instrument utgivna av emittenter med ett lägre kreditbetyg betraktas i allmänhet som värdepapper med en högre kreditrisk och större risk för betalningsinställelse, jämfört med värdepapper som är utgivna av emittenter med ett högre kreditbetyg. Kreditvärdigheten (solvensen och betalningsviljan) för en emittent kan förändras kraftigt över tiden. Om en emittent inte kan betala ränta och nominellt belopp i tid kan obligationen förlora mycket, eller hela sitt värde. Kreditrisken går att minska genom att placera i flera olika företag.

#### Valutarisk

Valutarisk kan uppstå om en fond placerar i finansiella instrument som är utfärdade i andra valutor än fondens basvaluta. Detta innebär att fonden då är utsatt för valutarisk på grund av förändringar i växelkurserna. Det kan påverka värdet på placeringarna både positivt och negativt.

#### Likviditetsrisk

Att placeringar inte går att omsätta i tid till ett rimligt pris benämns likviditetsrisk. Under normala marknadsförhållanden krävs att det finns både köpare och säljare för att ett värdepapper ska kunna omsättas. För en fond som placerar tillgångarna helt eller delvis i aktier kan likviditetsrisken vara betydande även vid normala marknadsförhållanden. Möjligheterna att placera fondens tillgångar på ett sätt som väsentligt avviker från den marknad som fonden placerar i kan därför vara begränsad i varierande grad. Likviditetsrisken är normalt mycket hög vid oväntade händelser och under extrema marknadsförhållanden.

#### Motparts- och avvecklingsrisker

Motpartsrisk uppstår om en motpart inte fullgör sina skyldigheter, exempelvis genom att inte betala en fastställd summa eller inte leverera värdepapper enligt överenskommelse. Om

## Placeringsinriktning och riskinformation, forts

fonden gör så kallade "Over The Counter" (OTC) -affärer eller använder sig av tekniker för effektiviserad värdepappersförvaltning, kan den utsättas för risker relaterade till kreditvärdigheten hos dess motparter. Om fonden ingår transaktioner som inkluderar terminer, optioner och swapavtal eller utnyttjar andra derivattekniker, kan detta innebära att fonden blir utsatt för risken att en motpart inte fullföljer sitt åtagande. Bolag inom SEB-koncernen kan vara motpart vid handel i fondens värdepappersportfölj. Val av motpart vid handel sker alltid i syfte att uppnå bästa möjliga villkor. Avvecklingsrisk är risken att en uppgörelse i ett överföringssystem inte kan utföras som förväntat.

### Risker med derivatinstrument

Derivatinstrument är ett samlingsnamn för instrument som får sin avkastning från underliggande tillgångar. Instrumenten är avtal om att köpa eller sälja den underliggande tillgången vid ett framtida förutbestämt datum till ett förutbestämt pris. Avtalets värdeförändring bestäms till stor del av värdeförändringen i den underliggande tillgången. Vanligt förekommande derivatinstrument är terminer, optioner och swapavtal. En egenskap med derivatinstrument är att de ger innehavaren möjlighet att få hela värdeförändringen i det underliggande instrumentet, utan att betala dess fulla pris. Risken vid till exempel optionsaffärer är att marknadspriset faller under det i avtalet fastställda priset, vilket lämnar avtalet utan värde eller resulterar i en skuld. För vissa derivatinstrument kan små prisförändringar i den underliggande tillgången orsaka en stor prisförändring i derivatinstrumentet.

### Operativ risk

Risken för förlust på grund av exempelvis systemhaveri, fel orsakade av den mänskliga faktorn, fel i verksamhetsprocesser eller av externa händelser.

### Fondens riskbedömningsmetod

Derivatinstrument används för att nå investeringsmålet samt effektivisera förvaltningen. För att beräkna Fondens sammantagna exponeringar används den så kallade åtagandemetoden.

### Fondens risk/avkastningsprofil

Fonden är riskkategoriserad enligt en sjugradig skala där 1 står för lägst risk och 7 för högst risk. Kategori 1 innebär inte att Fonden är riskfri. Beräkningen av riskindikatorn grundar sig på en metod som är gemensam för alla EU-medlemsländer. Risk/avkastningsindikatorn visar sambandet mellan risk och möjlig avkastning vid en investering i fonden.

En fonds kategorisering grundas på volatiliteten som är ett mått på hur avkastningen varierar över tiden. Kategoriseringen kan grundas på beräkningar med hjälp av avkastningar från fondens handelscykel under de senaste fem åren. I de fall historiskt underlag saknas kan information om fondens jämförelseindex eller andra beräkningsmetoder användas. För vissa typer av fonder kan andra metoder användas för att bestämma riskkategorin, exempelvis den maximala risknivå som fonden tillåter eller risknivån för fondens referensportfölj. På vilket sätt Fondens kategorisering har bestämts framgår av faktabladet. Riskkategoriseringen ska således endast

ses som en indikation på Fondens framtida kategorisering. Det innebär även att en fonds riskkategori kan komma att ändras över tiden.

Riskkategori	Volatilitet (%)
1	0 - 0,5
2	0,5 - 5
3	5 - 12
4	12 - 20
5	20 - 30
6	30 - 80
7	80 -

De risker fonden är exponerad mot som inte fångas av ovan beskrivna risk/avkastningsindikator beskrivs i fondens faktablad under rubriken "Riskindikator". Där framgår även fondens aktuella riskkategorisering som kan ändras över tiden.

### Regelbunden information om risk samt finansiell hävstång

Bolaget lämnar regelbunden information om risk och finansiell hävstång enligt följande:

Information om aktuell riskprofil och de riskhanteringssystem som tillämpas lämnas i fondens Informationsbroschyr, vilken uppdateras på årsbasis. I årsberättelsen för fonden lämnas också information om max- och miniminivå för det sammantagna finansiella hävstångsbeloppet.

Uppgift om förändringar i den högsta nivå av finansiell hävstång som får användas för fondens räkning och rätt att förfoga över säkerheter eller andra garantier som har lämnats enligt ordningen för finansiell hävstång lämnas i fondens Informationsbroschyr.

Uppgift om förändringar av villkoren för inlösen av fondandelar samt information om det sker en senareläggning av inlösen av fondandelar enligt 4 kap. 13 a § lagen om värdepappersfonder eller fonden stängs för inlösen av fondandelar.

### Fondens riskprofil

Fondens målsättning är att risknivån ska motsvara den för SIX Sweden Sustainability Index Gross Index.

Sparande i aktier innebär risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk).

Placeringsinriktningen innebär att Fondens medel placeras så att Fondens utveckling följer det svenska indexet SIX Sweden Sustainability Index Gross Index, vilket innebär att Fondens medel är riskexponerade mot en begränsad geografisk marknad. Detta medför normalt att marknadsrisken blir högre än för en aktiefond som placeras på flera geografiska marknader.

Fondens värde kan variera kraftigt på grund av dess sammansättning, den marknad eller de marknader som fonden är exponerad mot och de förvaltningsmetoder förvaltaren använder sig av.

Fonden har rätt att använda derivatinstrument, både standardiserade och OTC-derivat, som ett led i placeringsinriktningen.



Derivatinstrument har en så kallad hävstångseffekt vilket innebär att Fondens känslighet mot marknadsförändringar ökas eller minskas (marknadsrisk). Enligt lagen om värdepappersfonder får Fonden utnyttja en hävstångseffekt på två gånger marknadsrisken. I praktiken kommer risknivån att ligga väl under denna nivå. Fondens risktagande följs upp och kontrolleras regelbundet och noggrant för att säkerställa att lagar, föreskrifter och fondbestämmelser efterföljs.

### Fondens hållbarhetsrisk

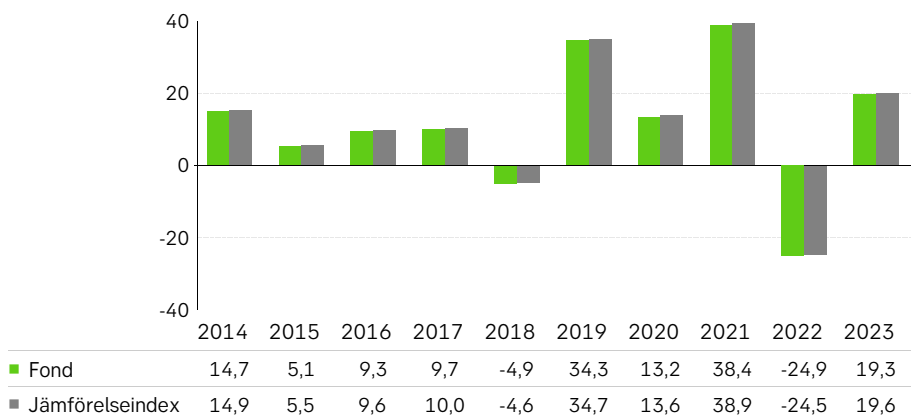
Fonden främjar bland annat miljörelaterade eller sociala egenskaper (Artikel 8 i SFDR). Fonden förvaltas passivt och har som målsättning att skapa avkastning i linje med sitt jämförelseindex. Hållbarhetsrelaterade egenskaper främjas genom exkluderingar i linje med vår hållbarhetspolicy och dessutom genom fondens aktiva ägarstyrningsprocess som syftar till att driva och påverka utvecklingen i bolagen vi investerar i, som identifieras genom den integrerade hållbarhetsmodellen.

I hållbarhetsmodellen utgör utvärdering av hållbarhetsrisker 50 procent. Modellen mäter företags exponering mot hållbarhetsrisk och i vilken utsträckning de hanterar denna risk. Riskbedömningen inkluderar också en bedömning av hur företag hanterar eventuella kontroverser gentemot sina intressenter, för att se hur de faktiskt hanterar de hållbarhetsrisker som affärsmodellen ger upphov till. Detta hjälper oss att följa upp bolagens rapporterade hantering av hållbarhetsrisker i förhållande till deras faktiska arbete med materiella hållbarhetsrisker.

Genom att använda många oberoende informationskällor, med ett stort antal olika indikatorer skräddarsydda för varje enskild sektor, är vår bedömning att hållbarhetsmodellen säkerställer att väsentliga hållbarhetsrisker återspeglas i investeringsbeslut.

Genom denna helhetssyn på riskhantering identifieras också bolag som agerar på ett sätt som strider mot etablerade normer avseende bolagsstyrning och god marknadssed och därmed försvårar eller förhindrar förverkligandet av de globala hållbarhetsmålen.

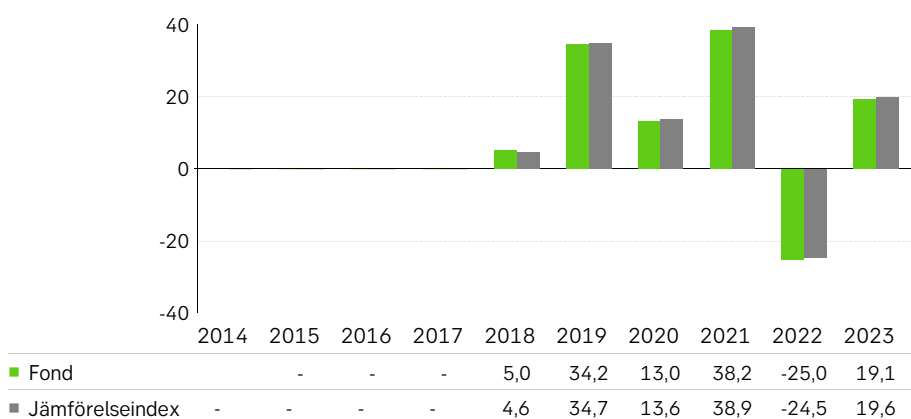
### 3. Historisk avkastning



Bredvid visas den historiska avkastningen för de senaste tio kalenderåren eller, om fonden/andelsklassen funnits kortare tid, så många hela år som fonden/andelsklassen funnits.

Den historiska avkastningen avser den ursprungliga fonden som sedan den 4 april 2017 är en utdelande andelsklass A.

Historisk avkastning utgör ingen garanti för framtida avkastning.



Bredvid visas den historiska avkastningen för de senaste tio kalenderåren eller, om fonden/andelsklassen funnits kortare tid, så många hela år som fonden/andelsklassen funnits.

Den historiska avkastningen avser den icke utdelande andelsklassen B som startade den 4 april 2017.

Historisk avkastning utgör ingen garanti för framtida avkastning.

## 4. Information om Bolaget

---

### Bolagets namn

SEB Investment Management AB ("Bolaget"). Helägt dotterbolag till Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ) ("SEB"). Bolaget är en del av SEB Asset Management divisionen. Inom ramen för Bolagets fondverksamhet förvaltar Bolaget värdepappersfonder och alternativa investeringsfonder. Sedan den 5 april 2006 har Bolaget tillstånd att bedriva fondverksamhet enligt lagen (2004:46) om värdepappersfonder. Bolaget har sedan 20 maj 2014 även tillstånd att förvalta alternativa investeringsfonder enligt lagen (2013:561) om förvaltare av alternativa investeringsfonder.

### Datum för Bolagets bildande

1978-05-19

### Bolagets rättsliga form och storlek på aktiekapital

Aktiebolag, 1 500 0000 SEK

### Bolagets säte och huvudkontor

Stockholm, Sverige

### Filialer

#### SEB Investment Management AB, Luxembourgfilialen

4, rue Peternelchen, L-2370 Howald, Luxembourg  
Telefon: +352 26 23 1

#### SEB Investment Management AB, Helsingforsfilialen

Södra Esplanaden 18, 00130 Helsingfors, Finland  
Telefon +358 961628000

#### SEB Investment Management AB, Köpenhamnsfilialen

Bernstorffsgade 50, 1577 København V  
Postboks 2098, Danmark Telefon +45 33 28 10 00

### Styrelsens ledamöter

Johan Wigh, ordförande, extern ledamot, Partner Törngren Magnell & Partners Advokatfirma  
Mikael Huldt, extern ledamot, Head of Asset Management, AFA Försäkring  
Louise Hedberg, extern ledamot, verkställande direktör och senior rådgivare Penny to Pound AB

### Ledande befattningshavare

Elisabet Jamal Bergström, tf verkställande direktör och chef hållbarhet & ägarstyrning  
Henrik Åhman, operativ chef  
Caroline Rifall, chefsjurist  
Ulf Grunnesjö, ekonomichef  
Anna Frey, personalchef, SEB  
Christian Lindstroem Lage, investeringschef  
Katarina Höller, ansvarig för kontrollfunktionerna  
Matthias Ewald, filialchef Luxemburg  
Antti Katajisto, filialchef Finland  
Erik Hallengren, filialchef Danmark

### Övriga befattningshavare

Terese Cederlund, ansvarig Riskkontroll  
Fredrik Lundberg, ansvarig Regelefterlevnad  
Johan Lindqvist, ansvarig Internrevision, SEB

### Ersättningspolicy

Uppgifter om Bolagets ersättningspolicy finns på [www.seb.se/fondbolaget](http://www.seb.se/fondbolaget) under "Ersättningspolicy". Där finns uttömmande information om ersättningspolicyn och hur ersättningar och förmåner beräknas, vilka som är ansvariga för att bevilja dem samt ersättningskommitténs sammansättning. En papperskopia av informationen kan på begäran erhållas kostnadsfritt av Bolaget.

### Revisorer

Bolagets tillika Fondens revisionsbolag är Ernst & Young AB och utsedd revisor är Carl Rudin.

### Värdepappersfonder och alternativa investeringsfonder förvaltade av Bolaget

#### Sverige

Charlottes Fond,  
Ethos Aktiefond,  
Ethos Räntefond,  
Hercules Fonden,  
SEB Active 80,  
SEB Active 55,  
SEB Active 30,  
SEB Active 20,  
SEB Aktiesparfond,  
SEB Asienfond ex Japan,  
SEB Blandfond Sverige,  
SEB Blockchain Economy Exposure Fund,  
SEB Dynamisk Aktiefond,  
SEB Emerging Marketsfond,  
SEB Emerging Markets Exposure Fund (SEB Emerging Markets indexnära),  
SEB Europafond,  
SEB Europafond Småbolag,  
SEB Fastighetsfond Norden,  
SEB FRN Fond,  
SEB Företagsobligationsfond,  
SEB Global Aktiefond,  
SEB Hybrid Capital Bond Fund,  
SEB Institutionell Obligationsfond SEK,  
SEB Korträntefond SEK,  
SEB Likviditetsfond SEK,  
SEB Läkemedelsfond,  
SEB NanoCap,  
SEB Nordamerikafond Små och Medelstora Bolag,  
SEB Nordamerikafond Småbolag,  
SEB Nordenfond,  
SEB Obligationsfond Flexibel SEK,  
SEB Obligationsfond SEK,  
SEB PB Aktiv 25,  
SEB PB Aktiv 50,  
SEB PB Aktiv 75,

## Information om Bolaget, forts

---

SEB Start 100,  
SEB Start 75,  
SEB Start 50,  
SEB Start 25,  
SEB Stiftelsefond Balanserad,  
SEB Stiftelsefond Sverige,  
SEB Stiftelsefond Utland,  
SEB Sverige Expanderad,  
SEB Sverige Indexfond,  
SEB Sverige Indexnära  
SEB Sverigefond,  
SEB Sverigefond Småbolag,  
SEB Sverigefond Småbolag Chans/Risk,  
SEB Swedish Value Fund,  
SEB Teknologifond,  
SEB Världenfond,  
SEB WWF Nordenfond,  
SEB Östeuropafond,  
Sophiahemmets Fond,  
Specialfond SLS,  
Svenska Läkaresällskapets Fond

### Luxemburg

SEB Active Owners Impact Fund,  
SEB Arkadia Bostad,  
SEB Asset Selection Fund,  
SEB Climate Focus High Yield Fund,  
SEB Concept Biotechnology,  
SEB Corporate Bond Fund EUR,  
SEB Corporate Bond Fund SEK,  
SEB Credit Opportunity V,  
SEB Danish Mortgage Bond Fund,  
SEB Domestica V,  
SEB Dynamic Bond Fund,  
SEB Eastern Europe Small and Mid Cap ex Russia Fund,  
SEB ELTIF- Private Equity I  
SEB Emerging Markets Fund,  
SEB Eureka Fixed Income Relative Value,  
SEB Euro Bond Fund,  
SEB Euro Short Rate Fund,  
SEB Europe Exposure Fund,  
SEB Euroland Free of Management Fee,  
SEB European Equity Small Caps,  
SEB Finland Optimized Exposure Fund,  
SEB Finland Small Cap Fund,  
SEB Global Climate Opportunity Fund,  
SEB Global Fund,  
SEB Green Bond Fund,  
SEB Index Linked Bond Fund SEK,  
SEB Listed Private Equity Fund,  
SEB Micro Cap Fund SICAV-SIF,  
SEB Microfinance IX SEK,  
SEB Microfinance IX EUR,  
SEB Microfinance X SEK,  
SEB Microfinance X EUR,  
SEB Mixed Fund 30,  
SEB Mixed Fund 50,  
SEB Mixed Fund 80,  
SEB Modern Aggressive Fund,  
SEB Modern Growth Fund,  
SEB Nordic Green Energy Fund,

SEB Nordic Small Cap Fund,  
SEB Norway Focus Fund,  
SEB Pension Fund,  
SEB Pension Fund Extra,  
SEB Pension Fund Plus,  
SEB Private Equity Global Direct III,  
SEB Private Equity Nordic Direct II EUR,  
SEB Private Equity Nordic Direct II SEK,  
SEB Private Equity Opportunity Fund I,  
SEB Private Equity Opportunity Fund II,  
SEB Private Equity Opportunity Fund III,  
SEB Private Equity Opportunity IV,  
SEB Private Equity Global Partnership II,  
SEB Private Equity Global Partnership II Access,  
SEB Private Equity Sustainable Direct I,  
SEB Short Bond Fund EUR,  
SEB Short Bond Fund SEK,  
SEB Europe Equity Fund,  
SEB Global Equal Opportunity Fund,  
SEB Sweden Equity Fund,  
SEB Nordic Future Opportunity Fund,  
SEB Global Exposure Fund,  
SEB Global High Yield Fund,  
SEB US Exposure Fund,  
SEB Technology Fund,  
SEB US Focus Core Fund,  
SEB USD Currency Fund.

## 5. Fondbestämmelser

---

### § 1 Fonden

Fondens namn är SEB Sverige Indexfond (nedan kallad "fonden").

Fonden är en värdepappersfond enligt lagen (2004:46) om värdepappersfonder ("LVF").

Fonden bildas genom kapitaltillskott från allmänheten och fondens förmögenhet ägs av andelsägarna gemensamt. Andelarna i varje andelsklass medför lika rätt till den egendom som ingår i fonden. Fonden är inte en juridisk person och kan inte förvärva rättigheter eller ta på sig skyldigheter. Egendom som ingår i fonden får inte utmätas och andelsägarna svarar inte för förpliktelser som avser en fond. Fonden förvaltas av ett fondbolag, som företräder andelsägarna i alla frågor som rör fonden.

Fonden består av följande andelsklasser:

- A) Utdelande andelsklass med lägsta belopp vid första teckning av andelar 5 000 000 kronor.
- B) Icke utdelande andelsklass

Innehållet i fondbestämmelserna är gemensamt för samtliga andelsklasser med undantag för bestämmelserna om minsta belopp vid teckning i § 9, Försäljning och inlösen av fondandelar, Avgifter i § 11 samt Utdelning i § 12.

### § 2 Fondförvaltare

Fonden förvaltas av SEB Investment Management Aktiebolag, 556197-3719 (nedan kallat "fondbolaget").

### § 3 Förvaringsinstitutet

Fondens tillgångar förvaras av Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ), 502032-9081, såsom förvaringsinstitut (nedan kallat "förvaringsinstitutet").

Förvaringsinstitutet ska verkställa de beslut av fondbolaget som avser fonden och ta emot och förvara den egendom som ingår i fonden samt kontrollera att värdering, inlösen och försäljning av fondandelar sker i enlighet med lag, föreskrifter och fondbestämmelser. Förvaringsinstitutet ska dessutom kontrollera att de beslut fondbolaget fattat avseende fonden inte strider mot bestämmelserna i lag, föreskrifter eller fondbestämmelserna.

### § 4 Fondens karaktär

Fonden är en indexfond som syftar till att efterlikna utvecklingen av SIX Sweden Sustainability Index Gross Index, nedan benämnt "SIXSESUSTAINGI". SIXSESUSTAINGI är ett index bestående av samtliga bolag på Stockholmsbörsen exklusive de bolag som inte uppfyller indexets särskilda krav på sociala, miljömässiga samt etiska kriterier.

### § 5 Fondens placeringsinriktning

#### (i) Tillgångsslag

Fondens medel får placeras i överlåtbara värdepapper, fondandelar, penningmarknadsinstrument, derivatinstrument och

på konto hos kreditinstitut. I fonden får även ingå de likvida medel som behövs för fondens förvaltning.

Vid placering i derivatinstrument ska underliggande tillgångar utgöras av eller hänföra sig till sådana tillgångar som avses i 5

kap. 12 § LVF

#### (ii) Allokering m. m.

Fondens placeringar ska syfta till att efterlikna utvecklingen av SIXSESUSTAINGI och därigenom uppnå en värdetillväxt, som i stort motsvarar utvecklingen av detta index.

SIXSESUSTAINGI är ett index som består av samtliga bolag noterade på Stockholmsbörsen, exklusive de bolag som inte följer indexets sociala, miljömässiga samt etiska kriterier. Bolag som är involverade i verifierade kränkningar av internationella normer och standarder gällande miljö, mänskliga rättigheter, arbete och korruption eller är involverade i kontroversiella vapen exkluderas. Krav på hållbarhet omfattar ett speciellt fokus på bolag med involvering i fossila bränslen såsom kol, olja och gas där en generell exkludering gäller för bolag med som är involverade i aktiviteter kopplade till produktion, utvinning eller bearbetning av fossila bränslen. Indexet exkluderar vidare företag med en omsättning över 5% generellt kopplat till aktiviteter inom alkohol, kommersiella spel, tobak, pornografi eller militärutrustning. Se fondens hållbarhetsprofil. Mer information finns i fondens informationsbroschyr.

Fonden får i syfte att effektivisera hanteringen av likvida medel placera medel i penningmarknadsinstrument.

Fonden får placera högst tio procent av dess värde i andra fonder eller fondföretag.

### § 6 Marknader

Fondens medel får placeras på en reglerad marknad eller på en motsvarande marknad utanför EES samt på en annan marknad, inom eller utom EES, som är reglerad och öppen för allmänheten och som omfattas av fondens placeringsinriktning.

### § 7 Särskild placeringsinriktning

Fonden får placera i överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som avses i 5 kap. 5 § LVF.

Derivatinstrument får användas som ett led i placeringsinriktningen.

Fonden får även använda OTC-derivat.

Fonden har Finansinspektionens tillstånd enligt 5 kap. 7 § LVF. Fonden har en särskild placeringsinriktning mot indexet SIXSESUSTAINGI, ett marknadsvärdesviktat index som tar hänsyn till den avkastning som aktieägarna erhåller i form av utdelning.

### § 8 Värdering

Fondens värde beräknas genom att från fondens tillgångar dra av de skulder som avser fonden. Värdet av en fondandel



## Fondbestämmelser, forts

är fondens värde delat med antalet utestående fondandelar, med beaktande av de villkor som är förenade med respektive andelsklass.

Värdet av fondandel beräknas normalt varje svensk bankdag av fondbolaget.

Fondbolaget har rätt att ställa in värderingen av fonden om värderingen av fondens tillgångar inte kan göras på ett sätt som säkerställer andelsägarnas lika rätt, d.v.s. om fondens tillgångar inte kan värderas till marknadsvärde. Fonden ska i dessa fall värderas så snart andelsägarnas lika rätt kan säkerställas.

Finansiella instrument som ingår i fonden värderas till marknadsvärde. För att avgöra marknadsvärdet används, för finansiella instrument som handlas på en aktiv marknad, i första hand senaste betalkurs. För finansiella instrument som inte handlas på en aktiv marknad härleds marknadsvärdet utifrån information om liknande transaktioner som skett under marknadsmässiga omständigheter den senaste tidsperioden. Om dessa metoder inte går att tillämpa eller enligt fondbolagets bedömning blir uppenbart missvisande fastställs marknadsvärdet utifrån senaste köp- eller säljkurs, alternativt genom en värderingsmodell som är etablerad på marknaden. För OTC-derivat saknas det normalt offentliga uppgifter om senaste betalkurs likväl som senaste köp- och säljkurs. Marknadsvärdet för OTC-derivat fastställs därför normalt baserat på allmänt vedertagen värderingsmodell. Värdet på valutaterminer fastställs till exempel utifrån affärsdagens marknadskurs med en justering för ränteskillnaden mellan valutorna som handlas och terminens löptid.

För överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som avses i 5 kap. 5 § LVF görs, för det fall en aktiv marknad saknas, en särskild värdering där ett marknadsvärde fastställs på objektiva grunder då bland annat följande faktorer kan beaktas:

- möjligheten att omsätta instrumentet
- marknadspriser från icke reglerad marknad eller andra oberoende källor
- anskaffningsvärdet
- diskonterade kassaflöden (nuvärdesvärdering)
- kapitalandel av det egna kapitalet (bokslutsvärdering)
- bolagshändelser med påverkan på marknadsvärdet.

### § 9 Försäljning och inlösen av fondandelar

Fonden är normalt öppen för försäljning och inlösen av fondandelar varje svensk bankdag, dock inte sådana bankdagar då värdering av fondens tillgångar inte kan göras på ett sätt som säkerställer andelsägarnas lika rätt, till exempel till följd av att en eller flera av de marknader som fondens handel sker på är helt eller delvis stängda.

Fondbolaget har rätt att senarelägga försäljning och inlösen av andelar i fonden, om det finns särskilda skäl för åtgärden och det är motiverat med hänsyn till fondandelsägarnas intresse. Begäran om försäljning eller inlösen som kommer fondbolaget tillhanda under denna tid ska verkställas i den

ordning de inkommit till den kurs som fastställs första bankdagen efter det att sådan omständighet inte längre föreligger.

För andelsklass A är lägsta belopp vid första teckning av andelar 5 000 000 kr.

För andelsklass B finns inget krav på minsta belopp vid första teckning av andelar.

Försäljnings- respektive inlösenpris för fondandel uppgår till fondandelsvärdet den bankdag som begäran om försäljning (köporder) respektive inlösen (säljorder) har kommit fondbolaget tillhanda.

Försäljning och inlösen av en fondandel ska verkställas bankdagen efter att begäran har kommit fondbolaget tillhanda med avdrag för eventuell inlösen- eller försäljningsavgift enligt § 11 om begäran inkommit före den bryttid som anges i fondens informationsbroschyr. Med verkställighet avses exekvering av köp- respektive säljorder.

Försäljning och inlösen sker till en för andelsägaren vid begäran om försäljning eller inlösen inte känd kurs. Uppgifter om försäljnings- och inlösenpris avseende föregående bankdag kan erhållas hos fondbolaget, förvaringsinstitutet och Skandinaviska Enskilda Banken AB.

Försäljning och inlösen av fondandelar sker genom Skandinaviska Enskilda Banken AB eller på annat av fondbolaget angivet sätt.

Begäran om försäljning respektive inlösen av fondandelar får återkallas endast om fondbolaget medger detta.

Om, vid begäran om inlösen, medel inte finns tillgängliga i fonden ska medel anskaffas genom försäljning av fondens egendom och inlösen verkställas så snart det är möjligt.

### § 10 Extraordinär händelse

Fonden kan stängas för försäljning och inlösen vid extraordinär händelse som innebär att fonden inte kan värderas enligt § 8 på ett sätt som säkerställer andelsägarnas lika rätt eller andelsägarnas intresse.

### § 11 Avgifter och ersättning

Ur fondens medel ska ersättning betalas till fondbolaget för fondens förvaltning. Ersättningen inkluderar kostnader för förvaring, tillsyn och revisorer. Såvitt avser andelsklass A utgår en fast ersättning med ett belopp motsvarande högst 0,25% per år av fondens värde. Beträffande andelsklass B utgår en fast ersättning med ett belopp motsvarande högst 0,5% per år av fondens värde. Ersättningen beräknas dagligen med  $1/365$ -del.

Transaktionskostnader, såsom courtage, skatter och leverans samt övriga kostnader i anledning av fondens köp och försäljning av tillgångar ska belasta fonden. Vidare ska skatter enligt lag belasta fonden.

### § 12 Utdelning

A) Utdelande andelsklass

Andelsklassen är utdelande.

### A) Icke utdelande andelsklass

Andelsklassen lämnar ingen utdelning

Fondbolaget får en gång per år fatta beslut om utdelning till andelsägarna. Utdelning beräknas utifrån den utdelande andelsklassens andel av fondens värde. Grunderna för eventuell utdelning utgörs av avkastning på fondens medel eller annat utdelningsbart belopp. Utdelningen kan såväl överstiga som understiga avkastningen på fondens medel, om detta är i fondandelsägarnas intresse.

Utdelning till andelsägarna från fonden sker i maj månad året efter räkenskapsåret och tillkommer fondandelsägare som på fastställd utdelningsdag är registrerad för fondandel. Fondbolaget har även rätt att besluta om extra utdelning under året, om det ligger i andelsägarnas intressen.

Fondbolaget ska i tillämpliga fall göra avdrag för den skatt som enligt lag ska innehållas för andelsägare på utdelningen. För resterande belopp ska fondbolaget förvärva nya fondandelar för andelsägarnas räkning. Andelsägaren ska härvid erhålla det ytterligare antal andelar som svarar mot det belopp som tillkommer denne.

Värdet på de icke utdelande fondandelarna som ingår i fonden påverkas inte av utdelning. Relationstalet mellan värdet på de utdelande fondandelarna respektive de icke utdelande andelarna förändras däremot av utdelningen. Relations- talet förändras årligen i samband med utdelningen.

För utdelning avseende pensionssparmedel som placeras av pensionssparinstitut för pensionssparares räkning och för utdelning avseende försäkringspremier som placerats av försäkringsbolag för försäkringstagares räkning gäller särskilda regler.

Ytterligare information om målsättningen avseende utdelningens storlek finns i fondens informationsbroschyr.

### § 13 Räkenskapsår

Räkenskapsår för fonden är kalenderår.

### § 14 Halvårsredogörelse och årsberättelse, ändring av fondbestämmelserna

Fondbolaget ska för fonden lämna en årsberättelse inom fyra månader från räkenskapsårets utgång och en halvårsredogörelse för räkenskapsårets första sex månader inom två månader från halvårets utgång. Årsberättelsen och halvårsredogörelsen ska hållas tillgängliga hos fondbolaget och förvaringsinstitutet samt skickas till de andelsägare som begär detta.

Ändring av fondbestämmelserna ska godkännas av Finansinspektionen. Sedan Finansinspektionen har godkänt ändring av fondbestämmelserna ska de ändrade fondbestämmelserna hållas tillgängliga hos fondbolaget och förvaringsinstitutet samt, i förekommande fall, tillkännages på sätt som Finansinspektionen anvisar.

### § 15 Pantsättning

Andelsägare kan pantsätta sina andelar i fonden, såvida inte andelsägaren är ett pensionssparinstitut som placerat pensionssparmedel för pensionssparares räkning eller försäkringsbolag som placerat pensionssparmedel för pensionssparares räkning.

Pantsättning sker genom att pantsättaren eller panthavaren skriftligen underrättar fondbolaget om pantsättningen. Av underrättelsen ska följande framgå:

- vem som är fondandelsägare/pantsättare,
- vem som är panthavare,
- vilka fondandelar som omfattas av pantsättningen, och
- eventuella begränsningar av pantsättningens omfattning.

Underrättelsen ska undertecknas av pantsättaren.

Fondbolaget ska anteckna pantsättningen i andelsägarregistret samt skriftligen underrätta andelsägaren om registreringen av pantsättningen. Pantsättningen upphör när panthavaren skriftligen meddelat fondbolaget detta. Fondbolaget har rätt att ta ut ersättning av andelsägaren för registreringen. Uppgift om gällande ersättning finns i fondens informationsbroschyr.

### § 16 Ansvarsbegränsning

Fondbolaget eller förvaringsinstitutet ansvarar inte för skada som beror av svenskt eller utländskt lagbud, svensk eller utländsk myndighets åtgärd, krigshändelse, strejk, blockad, bojkott, lockout eller annan liknande omständighet. Förbehållet i fråga om strejk, blockad, bojkott och lockout gäller även om fondbolaget eller förvaringsinstitutet är föremål för eller vidtar sådan konfliktåtgärd. Skada som uppkommer i andra fall ska inte ersättas av fondbolaget eller förvaringsinstitutet om fondbolaget respektive förvaringsinstitutet varit normalt aktsamt. Fondbolaget eller förvaringsinstitutet ansvarar inte i något fall för indirekt skada, om inte den indirekta skadan orsakats av fondbolagets eller förvaringsinstitutets grova vårdslöshet.

Fondbolaget eller förvaringsinstitutet svarar inte för skada som orsakats av svensk eller utländsk börs eller annan marknadsplats, depåbank, central värdepappersförvarare, clearingorganisation, eller annan som tillhandahåller motsvarande tjänster, och inte heller av annan uppdragstagare som fondbolaget eller förvaringsinstitutet med tillbörlig omsorg anlitat. Detsamma gäller skada som orsakats av att ovan nämnda organisationer eller uppdragstagare blivit insolventa. Fondbolaget eller förvaringsinstitutet svarar inte för skada som kan uppkomma i anledning av förfogandeinskränkning som kan komma att tillämpas mot fondbolaget eller förvaringsinstitutet beträffande värdepapper.

Föreligger hinder för fondbolaget eller förvaringsinstitutet, på grund av omständigheter som anges i första stycket, att helt eller delvis utföra åtgärd enligt dessa bestämmelser eller köp eller inlösenuppdrag avseende fondandelar får åtgärden uppskjutas till dess hindret har upphört. Om fondbolaget eller förvaringsinstitutet till följd av sådan omständighet inte är skyldig att verkställa eller ta emot betalning eller leverans, ska

## Fondbestämmelser, forts

---

förvaringsinstitutet eller fondbolaget respektive andelsägaren inte vara skyldiga att erlægga eventuell dröjsmålsränta. Om ränta är utfäst ska fondbolaget respektive förvaringsinstitutet betala ränta efter den räntesats som gällde på förfallodagen.

Vad som nämns ovan i denna paragraf begränsar inte andelsägares rätt till skadestånd enligt 2 kap 21 § respektive 3 kap. 14 - 16 §§ LVF.

### **§ 17 Inskränkning i försäljningsrätt m.m.**

Fonden eller andelarna i fonden är inte och avses inte heller bli registrerade i enlighet med vid var tid gällande United States Securities Act 1933 eller United States Investment Companies Act 1940 eller annan tillämplig lagstiftning i USA.

Andelar i fonden (eller rättigheter till fondandelar) får inte eller kommer inte erbjudas, säljas eller på annat sätt distribueras till eller för räkning U.S. Persons (så som detta definieras i Regulation S i United States Securities Act och tolkas i United States Investment Companies Act 1940).

Andelar i fonden får inte heller erbjudas, säljas eller på annat sätt distribueras till fysiska eller juridiska personer om detta enligt fondbolagets bedömning skulle innebära eller medföra risk för

- (i) överträdelse av svensk eller utländsk lag eller författning,
- (ii) att fondbolaget måste vidta särskilda registrerings- eller andra åtgärder eller åsamkas betydande nackdelar ur skattemässigt eller ekonomiskt hänseende och detta skäliken inte kan krävas av fondbolaget, eller
- (iii) att fonden åsamkas skada eller kostnader som inte ligger i andelsägarnas intresse.

Den som vill förvärva andelar i fonden ska till fondbolaget uppge nationell hemvist. Andelsägare är vidare skyldig att, i förekommande fall, meddela fondbolaget eventuella förändringar av nationell hemvist.

Köpare av andelar i fonden ska vidare till fondbolaget bekräfta att han eller hon inte är en U.S. Person och att fondandelarna förvärvas genom en transaktion utanför USA i enlighet med Regulation S. Efterföljande överlåtelse av andelarna eller rättigheter till dessa får endast göras till en non-US person och ska ske genom en transaktion utanför USA som omfattas av undantag enligt Regulation S.

Om fondbolaget bedömer att det inte har rätt att erbjuda, sälja eller på annat sätt distribuera fondandelar enligt ovan äger fondbolaget rätt att dels vägra verkställighet av sådant uppdrag om köp av andelar i fonden, dels, i förekommande fall, utan förtida samtycke lösa in sådan andelsägares innehav av andelar i fonden för dennes räkning och utbetala sålunda tillkommande medel till denne.

Mall som avser upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

## Produktnamn: SEB Sverige Indexfond

Identifieringskod för juridiska personer: 5299006M3PVQG0DNQK41

### Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hållbar investering:** en investering i ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något annat miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

**EU-taxonomin** är ett klassificeringssystem som läggs fram i förordning (EU) 2020/852, där det fastställs en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter**. Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.

#### Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

Ja

Nej

Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål: \_\_\_%**

i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%**

Den **främjar miljörelaterade och sociala egenskaper** och kommer, även om den inte har en hållbar investering som sitt mål, att ha en minandel på \_\_\_% hållbara investeringar

med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

med ett socialt mål

Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**



### Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

De miljömässiga och socialt hållbara egenskaperna som inkluderas är:

Aktivt ägarskap. Fonden ämnar påverka bolagens affärsmodeller i en mer hållbar riktning. Det sker exempelvis via bolagsdialoger, samverkansinitiativ och röstning på bolagsstämmor.

Exkluderingar. Fonden exkluderar emittenter som

bryter mot internationella normer, konventioner och standarder

verkar inom kontroversiella sektorer eller affärsområden, såsom tobak, cannabis för icke-medicinska ändamål, pornografi, kommersiell spelverksamhet, civila vapen och alkohol

är exponerade mot fossila bränslen eller annan affärsverksamhet med negativ miljömässig påverkan.

Fonden har dock möjlighet att äga bolag som bedöms vara i omställning i enligt med SEB Investment Managements hållbarhetspolicy.

För mer information se:

- SEB Investment Managements hållbarhetspolicy (sebgrou.com)
- Ytterligare information om SIMS-S (Rapport om hållbarhet och aktivt ägande 2021 (sebgrou.com))
- Ytterligare information om påverkansarbete (Aktivt ägarskap | SEB (sebgrou.com))

#### ● Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

De hållbarhetsindikatorer som används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas är

- exkludering av bolag som bryter mot internationella normer, konventioner och standarder, vilket mäts genom antalet bolag som exkluderats på grund av denna hållbarhetsindikator jämfört med fondens jämförelseindex eller investeringsunivers
- exkludering av bolag inom kontroversiella sektorer eller affärsområden, vilket mäts genom antalet bolag som exkluderats på grund av denna hållbarhetsindikator jämfört med fondens jämförelseindex eller investeringsunivers

**Hållbarhetsindikatorer** mäter uppnåendet av de miljörelaterade eller sociala egenskaperna som den finansiella produkten främjar.

- exkludering av bolag som är exponerade mot fossila bränslen eller annan affärsverksamhet med negativ miljömässig påverkan, vilket mäts genom antalet bolag som exkluderats på grund av denna hållbarhetsindikator jämfört med fondens jämförelseindex eller investeringsunivers
- påverka bolagen i en mer hållbar riktning, vilket mäts genom antalet bolag som är föremål för aktivt ägarskap antingen direkt, inklusive röstning på bolagsstämmor, eller via samarbetsorganisationer

● **Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?**

Ej tillämpligt

● **På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?**

Ej tillämpligt

*I EU-taxonomi fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.*

Principen om att inte orsaka betydande skada är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

*Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.*



## Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

**Huvudsakliga negativa konsekvenser** är investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljö, sociala frågor och personalfrågor, respekt för mänskliga rättigheter samt frågor rörande bekämpning av korruption och mutor.

Ja, Innan ett investeringsbeslut beaktas följande PAI:er:

· Exkluderingar

Bilaga 1 – Tabell 1 i kommissionen delegerade förordning (EU) 2022/1288

- PAI 4: Exponering mot företag som är verksamma inom sektorn för fossila bränslen
- PAI 10: Brott mot FN:s globala överenskommelse och OECD:s riktlinjer för multinationella företag
- PAI 14: Exponering mot kontroversiella vapen (antipersonella minor, klusterammunition, kemiska vapen och biologiska vapen)

Under investeringsperioden beaktas följande PAI:er:

- Påverkansdialoger med emittenter:

PAI 13 från Bilaga 1 – Tabell 1 i kommissionen delegerade förordning (EU) 2022/1288

Nej



## Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

**Investeringsstrategin** styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Fonden har som mål att generera en avkastning och riskprofil som ligger i linje med sitt jämförelseindex, frånsett de exkluderingar som görs utifrån fondbolagets hållbarhetspolicy.

Fonden är passivt förvaltd och investerar främst i aktier på den svenska marknaden.

Fondens jämförelseindex är ett återinvesterande aktieindex som består av alla bolag noterade på Stockholmsbörsen exklusive de bolag som inte uppfyller särskilda hållbarhetskriterier. Avkastningen bestäms av hur mycket fondens innehav ökar eller minskar i värde under din innehavsperiod.

● **Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?**

De bindande delarna i investeringsstrategin är:

Efterleva exkluderingskriterierna som beskrivs närmre i SEB Investment Managements hållbarhetspolicy.

Dessa kriterier inkluderar

- internationella normer och konventioner avseende mänskliga rättigheter, miljö, antikorrupktion eller arbetsrätt
- kontroversiella sektorer och affärsområden
- exponering mot fossila bränslen

För mer information se:

- SEB Investment Managements hållbarhetspolicy (sebgroupl.com)



· Ytterligare information om påverkansarbete (Aktivt ägarskap | SEB (sebgroup.com))

**Praxis för god styrning** omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatte-regler.

## ● Vad är policyn för att bedöma praxis för god styrning i investeringsobjekten?

SEB Investment Management säkerställer god bolagsstyrning i innehaven i den finansiella produkten, delvis genom exkludering och screening baserat på

- sektorscreening
- normbrott
- skyddsåtgärder såsom att följa FN:s globala överenskommelse, ILO:s konventioner och OECD:s riktlinjer i investeringsprocessen.

Screening för relevanta sanktioner görs också. Fondens investeringar övervakas fortlöpande även i dessa avseenden, vilket framgår av SEB Investment Managements hållbarhetspolicy.

Styrningen av de bolag som ingår i fonden bedöms utifrån flera ytterligare faktorer, inklusive

- styrelseledamöternas lämplighet och oberoende
- mångfald i styrelsen och ledningen
- lämpliga lönenivåer och rörlig ersättning (inklusive hållbarhetsrelaterade incitament)
- åtskillnad av bolagsledning och styrelseuppdrag
- antikorrupktion
- skatteflykt
- miljö- och klimatpåverkan
- mänskliga rättigheter
- arbetsförhållanden, både när det gäller bolagets egen verksamhet och dess leverantörskedja.

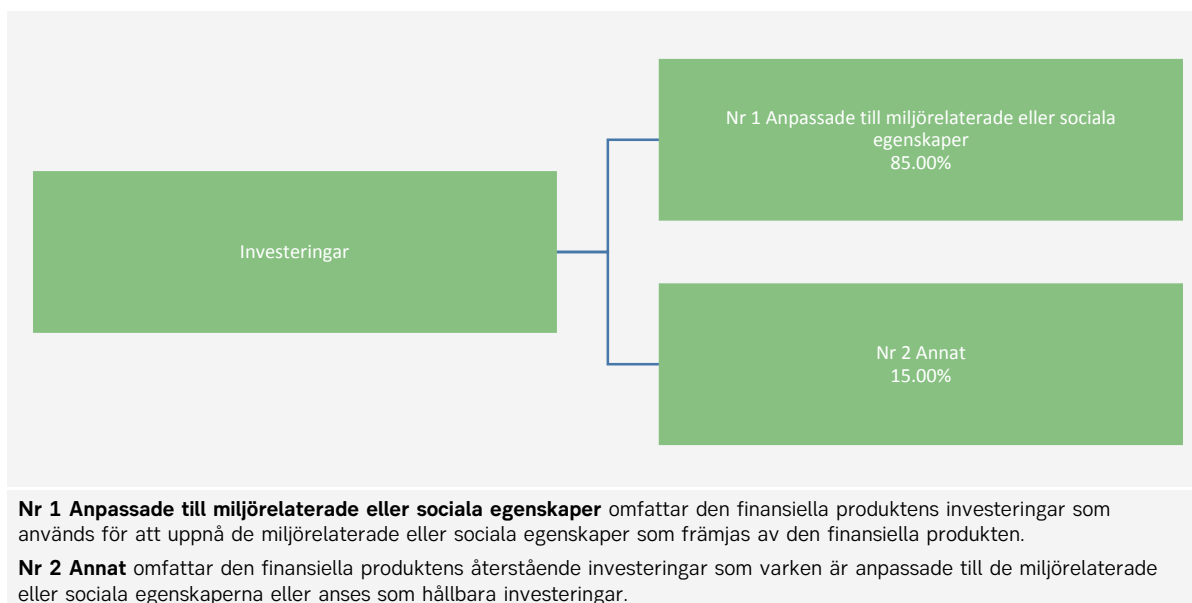
Mer information om SEB Investment Managements arbete med bolagspåverkan och ägarstyrning finns på: (Aktivt ägarskap | SEB (sebgroup.com))



## Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Minst 85 % främjar miljömässiga och sociala egenskaper. Resterande tillgångar utgörs av likvida medel och derivat för likviditetshantering och effektiv portföljförvaltning.



## ● Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?

Fonden använder inte derivat för att uppnå sina hållbarhetsmål.



Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxonomin?

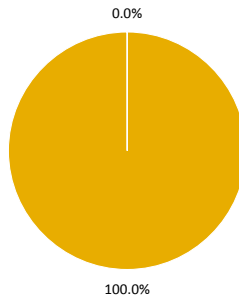
● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin<sup>1</sup>?**

- Ja:  
 I fossilgas  I kärnenergi  
 Nej

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonominpassade statliga obligationer är\*, visar den första grafen taxonominpassningen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar taxonominpassningen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.

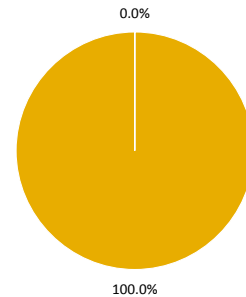
**1. Taxonomiförenlighet hos investeringar, inklusive statliga obligationer\***

- Taxonomiförenliga (ingen gas och kärnkraft)
- Icke Taxonomiförenliga



**2. Taxonomiförenlighet hos investeringar, exklusive statliga obligationer\***

- Taxonomiförenliga (ingen gas och kärnkraft)
- Icke Taxonomiförenliga



Denna graf representerar 100 % av den totala investeringen

\* I dessa grafer avses med "statliga obligationer" samtliga exponeringar i statspapper

● **Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?**

Likvida medel och derivat

Avsikten med likvida medel och derivat är möjliggöra effektiv likviditetshantering och portföljförvaltning.



Vilka investeringar är inkluderade i "Nr 2 Annat", vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

<sup>1</sup> Fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna ("begränsning av klimatförändringarna") och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin - se förklarande anmärkning i vänstra marginalen. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar?

**Referensvärden** är index för att mäta om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.

Nej



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer produktspecifik information finns på webbplatsen: <https://seb.se/bors-och-finans/fonder/fondlista#/funds/filter-retail>