

Bilaga V

Mall som avser regelbundna upplysningar för de finansiella produkter som avses i artikel 9.1-9.4a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn: Global Sustainable Leaders Small Cap

Identifieringskod för juridiska personer: 636700HSQ07FFFJIF657

Mål för hållbar investering

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?	
<input checked="" type="radio"/> Ja	<input type="radio"/> Nej
<input checked="" type="checkbox"/> Den gjorde hållbara investeringar med ett miljömål: _50_% <ul style="list-style-type: none"><input checked="" type="checkbox"/> i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin<input checked="" type="checkbox"/> i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin	<input type="checkbox"/> Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel på ___% hållbara investeringar <ul style="list-style-type: none"><input type="checkbox"/> med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin<input type="checkbox"/> med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin<input type="checkbox"/> med ett socialt mål
<input checked="" type="checkbox"/> Den gjorde hållbara investeringar med ett socialt mål: <u>49</u> %	<input type="checkbox"/> Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men gjorde inte några hållbara investeringar

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



I vilken utsträckning uppnåddes denna finansiella produkts mål för hållbar investering?

Fondens mål för hållbara investeringar är att investera i bolag som bidrar positivt till sociala och miljömässiga faktorer. Fonden uppnådde detta mål genom att fondens innehav, mätt genom förvaltarens egenutvecklade hållbarhetsmodell (Sustainability Cuve™) är branschledare inom ESG, bäst positionerade för övergången till en koldioxidsnål ekonomi och i linje med FN's mål för hållbar utveckling (UN SDG).

Fondens investeringar bidrog till följande miljömål i enlighet med Artikel 9 i förordning (EU) 2020/852:

- Begränsning av klimatförändringar

- b) Anpassning till klimatförändringar

Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?

Hållbarhetsindikatorerna mäter hur hållbarhetsmålen för denna finansiella produkt uppnås.

100% av fondens investeringar utgjordes av bolag vars Sustainability Cube™-score rankades över den 90:e percentilen inom respektive region och sektor.

- **Hur orsakade de hållbara investeringarna inte betydande skada för något mål för hållbar investering?**

Inget av fondens underliggande innehav bröt vid rapporttillfället mot internationella normer enligt UN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

Innehav verksamma inom branscher med stor risk för negativa hållbarhetseffekter exkluderas i enlighet med fondens exkluderingspolicy.

Fonden investerade endast i bolag vars Sustainability Cube™- Score rankades över den 90:e percentilen inom respektive region och sektor.

Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Fondens förvaltare beaktade indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer genom att:

Exkludera bolag inom sektorer med förhöjd hållbarhetsrisk.

Inkludera PAI-indikatorer som en delkomponent i modellen för bolagsval.

Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter?

Ja, inget av fondens innehav bröt under perioden mot internationella normer enligt OECD:s riktlinjer för multinationella företag eller FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter

Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Fondens förvaltare beaktade huvudsakliga negativa effekter på hållbarhetsfaktorer i flera steg av investeringsprocessen för att "inte göra betydande skada" enligt beskrivningen ovan. Utöver detta tilldelades företag med låga PAI-indikatorer en högre Sustainability Cube™-poäng, vilket i sin tur gjorde dem mer benägna att inkluderas i portföljen. På så sätt minskade Sustainability Cube™-ramverket de övergripande negativa effekterna av investeringsportföljen.



Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Största investeringarna	Sektor	% Tillgångar	Land
TrueBlue Inc	Industrials	1,6%	US
Itron Inc	Industrials	1,6%	US
Anywhere Real Estate Inc	Real Estate	1,5%	US
ICF International Inc	Technology	1,5%	US
Fulgent Genetics Inc	Health Care	1,5%	US
Duskin Co Ltd	Consumer Staples	1,5%	JP
Cross Country Healthcare Inc	Industrials	1,5%	US
McMillan Shakespeare Ltd	Financials	1,4%	AU
Progress Software Corp	Technology	1,4%	US
Implenia AG	Industrials	1,4%	CH
Cembra Money Bank AG	Financials	1,4%	CH
MYR Group Inc	Industrials	1,4%	US
Donnelley Financial Solutions	Technology	1,4%	US
Pitney Bowes Inc	Technology	1,4%	US
Korn Ferry	Industrials	1,4%	US

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör den finansiella produktens största andel investeringar under referensperioden, som är: 2022-12-31



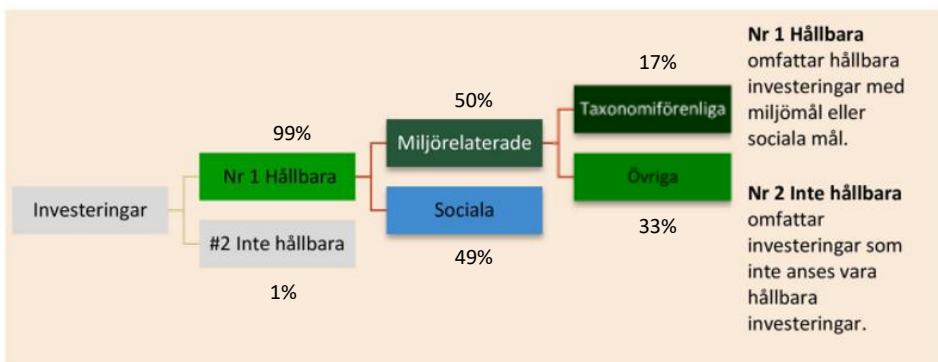
Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

99,2% av fondens medel utgjorde av hållbarhetsrelaterade investeringar.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Vad var tillgångsallokeringen?

Av de 99% av fondens medel som utgjorde hållbarhetsrelaterade investeringar var 50% miljörelaterade medan 49% var investeringar med sociala mål. 17% av fondens investeringar utgjordes av taxonomiförenliga investeringar. Fondens medel i icke hållbara investeringar om 1% bestod av likvida medel.



För att uppfylla EU-taxonomi omfattar kriterierna för fossilgas begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller kuldiuoxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller kärnenergi inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är ekonomiska

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?**

Bolaget har använt Bloomberg Industry Classification Standard (BICS) för att dela in fondernas investeringar i sektorer eftersom denna klassificering även inkluderar obligationer. Vid rapporteringstillfället var fördelningen följande:

Sektorer	% tillgångar
Communications - Advertising & Marketing	0,3%
Communications - Internet Media & Services	0,7%
Communications - Local TV & Radio Broadcast	0,5%
Communications - Wireless Telecommunications	0,8%
Communications - Wireline Telecommunications	0,4%
Consumer Discretionary - Auto Parts	0,8%
Consumer Discretionary - Automotive Retailers	0,6%
Consumer Discretionary - Homebuilding	2,2%
Consumer Discretionary - Other Spec Retail - Discr	0,7%
Consumer Discretionary - Specialty Online Retailers	1,0%
Consumer Discretionary - Sporting Goods Stores	0,7%
Consumer Discretionary - Toys & Games	0,8%
Consumer Staples - Food & Drug Stores	2,0%
Consumer Staples - Home Products	1,5%
Consumer Staples - Packaged Food	1,2%
Consumer Staples - Personal Care Products	0,5%
Energy - Oilfield Services & Equipment	2,8%
Energy - Refining & Marketing	0,1%
Energy - Renewable Energy Equipment	2,0%
Energy - Renewable Energy Project Dev	0,9%
Financials - Banks	4,8%
Financials - Consumer Finance	0,3%
Financials - Investment Management	5,8%
Financials - Mortgage Finance	1,7%
Financials - Other Financial Services	1,3%
Financials - P&C Insurance	0,9%
Financials - Private Equity	0,8%
Financials - Wealth Management	3,0%
Health Care - Health Care Facilities	1,0%
Health Care - Health Care Services	1,5%
Health Care - Health Care Supply Chain	1,3%
Health Care - Medical Devices	2,7%
Health Care - Medical Equipment	0,9%
Health Care - Specialty & Generic Pharma	1,1%
Industrials - Agricultural Machinery	0,6%
Industrials - Comm'l & Res Bldg Equip & Sys	0,7%
Industrials - Fabricated Metal & Hardware	0,6%

Industrials - Industrial Maintenance Svcs	0,9%
Industrials - Industrial Wholesale & Rental	0,8%
Industrials - Infrastructure Construction	3,5%
Industrials - Logistics Services	0,9%
Industrials - Measurement Instruments	2,9%
Industrials - Pollution Control Equipment	1,3%
Industrials - Professional Services	9,1%
Industrials - Rubber & Plastic	0,6%
Industrials - Waste Management	2,4%
Materials - Base Metals	0,8%
Materials - Building Materials	0,5%
Real Estate - Industrial Owners & Developers	0,9%
Real Estate - Multi Asset Class REIT	0,9%
Real Estate - Office REIT	3,3%
Real Estate - Real Estate Services	3,1%
Real Estate - Retail Owners & Developers	0,4%
Technology - Application Software	4,6%
Technology - Consumer Electronics	1,9%
Technology - Infrastructure Software	2,6%
Technology - IT Services	3,8%
Technology - Semiconductor Devices	0,6%
Technology - Semiconductor Mfg	1,2%
Utilities - Power Generation	2,1%
Utilities - Water Utilities	1,2%

Resterande placeringar var kassarelaterade placeringar.



I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?

17% av fondens investeringar var förenliga med EU-taxonomin.

- **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja:

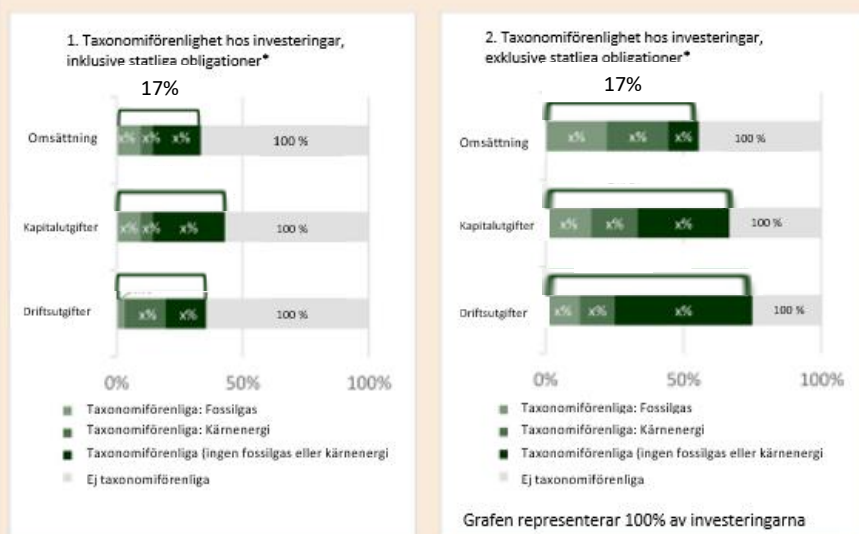
 I fossilgas I kärnenergi

 Nej

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **omsättning**, vilket återspeglar andelen av intäkterna från investeringsobjektens gröna verksamheter
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.



* I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

Förvaltaren har ej tillgång till tillförlitlig data för att beräkna innehavens taxonomiförenlighet sett till kapital- och driftsutgifter.

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?**

Fonden gjorde inga investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.



Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenliga med EU-taxonomin?

Andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenliga med EU-taxonomin var 33%.



Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?

Andelen hållbara investeringar med ett socialt mål var 49%.



Vilka investeringar inkluderades i kategorin "Inte hållbara", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

Syftet med investeringarna som inkluderades i kategorin "inte hållbara" var att effektivisera portföljförvaltning, likviditetsförvaltning och säkringsändamål. I fonden var dessa investeringar likvida medel och derivat. Då likvida medel och derivat och inte investeras i ett investeringsobjekt, kunde inga minimiskyddsåtgärder vidtas.



Vilka åtgärder har vidtagits för att uppnå målet för hållbar investering under referensperioden?

Fondens underliggande förvaltare investerade endast i bolag som vid som inte bröt mot internationella normer enligt UN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

I enlighet med fondens exkluderingspolicy investerade fondens underliggande förvaltare inte i bolag verksamma inom branscher med stor risk för negativa hållbarhetseffekter.

Fonden investerade endast i fonder som själva har hållbara investeringar som mål.

Kommenterad [CS1]: Står uttryckligen att det ska avse perioden.

Kommenterad [CS2R1]: Inget påverkansarbete?

Kommenterad [PH3R1]: Måste invänta fondernas egna engagement reports.