

Produktnamn: SEB Sverige Expanderad

Identifieringskod för juridiska personer:
529900JKD7ZKHUWHTN78

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.

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

Ja

Nej

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål: ___%**

Den **främjar miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 **gjorde inte några hållbara investeringar**



I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?

Fonden integrerar hållbarhetsrisker och -möjligheter genom att använda SEB Investment Managements hållbarhetsmodell (SIMS-S) som tillsammans med flera externa och interna datakällor ger varje potentiell investering (bolag) ett hållbarhetsbetyg. I SIMS-S betygsätts bolag baserat på hållbarhetsindikatorer. Parametrarna i modellen inkluderar, men är inte begränsade till, koldioxidutsläpp, klimatlösningar, mångfald och jämställdhet.

De miljömässiga och socialt hållbara egenskaperna som inkluderas är:

Integration. Fonden främjar emittenter som

- integrerar hållbarhet i sina affärsmodeller och strategier
- kan påvisa en hög grad av vilja och strävan att minska sina utsläpp av växthusgaser och/eller att bli mer energieffektiva.

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 enlighet med SEB Investment Managements hållbarhetspolicy.

För mer information se:

- SEB Investment Managements hållbarhetspolicy
- Ytterligare information om SIMS-S se hållbarhetspolicy
- Ytterligare information om aktivt ägarskap se principer aktieägarengagemang

● Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?

Utfallet för SIMS-S i slutet av 2022 var 6,02 i jämförelse med 5,71 för fondens jämförelseindex. Bland fondens innehav finns ett flertal bolag som kvalificerar högt enligt denna hållbarhetsindikator men samtidigt finns ett antal bolag som kvalificerar sig betydligt under snittet. Det betyder inte nödvändigtvis att de är

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

mindre hållbara än ett bolag med högre betyg utan det kan också vara en fråga om transparens där bolag som inte rapporterar tillräckligt mycket data får lägre betyg. Detta är ofta sant för mindre bolag som ofta inte har kommit lika långt som större bolag. I takt med att hållbarhetsrapportering förbättras räknar vi med att denna faktorn minskar i betydelse. Vi integrerar hållbarhet som en del av vår totala investeringsprocess och i vissa fall investerar vi i bolag som fortfarande är i början av sin hållbarhetsresa men där potentialen är stor för förbättringar. Vår målsättning är inte att maximera portföljen för en viss indikator utan snarare se det som ett av flera verktyg som vi kan använda när vi träffar bolag och har hållbarhetsdialoger för att skapa ökad förståelse och få en så komplett bild som möjligt av ett bolag. Fonden deltog i 33 bolagstämningar och bidrog till 49 hållbarhetsdialoger under 2022. Dessa dialoger skiljer sig i sin natur där vissa är mycket ingående och tidskrävande medan andra kan hanteras med begränsad tidsåtgång. Det innebär att antal dialoger inte är direkt kopplat till hur mycket tid och resurser som spenderas inom detta område. Fonden deltog också i 15 valberedningar. Utöver detta så är alltid hållbarhet en viktig agendapunkt när vi kontinuerligt träffar bolag. I genomsnitt har det fundamentala aktieteamet omkring 1000 bolagsmöten varje år. Fonden exkluderade 3,9 procent% av bolagen i jämförelseindex då dessa antingen brutit mot internationella normer, konventioner och standarder eller verkar i en industri som fondbolaget valt att inte investera i. Från det totala antalet bolag i indexet om 361 exkluderades 14 bolag.

- **...och jämfört med de föregående perioderna?**

Fondbolaget har under året utvecklat och kvantifierat vilka indikatorer fonden har. Utifrån den utvecklingen är det inte rättvisande att jämföra fondens indikatorer med tidigare perioder.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?**

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.

- **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?**

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.

- *Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.

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

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.

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.



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

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.



Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 1 januari 2022 till 31 december 2022

Största investeringarna	Sektor	% tillgångar	Land
Investor AB	Finans	10.11	Sverige
Hexagon AB	Informationsteknologi	7.08	Sverige
AstraZeneca PLC	Hälsovård	7.03	Storbritannien
Volvo AB	Industri	6.7	Sverige
Atlas Copco AB	Industri	6.49	Sverige
Skandinaviska Enskilda Banken AB	Finans	4.52	Sverige
Nibe Industrier AB	Industri	4.31	Sverige
Beijer Ref AB	Industri	3.46	Sverige
Alfa Laval AB	Industri	3.25	Sverige

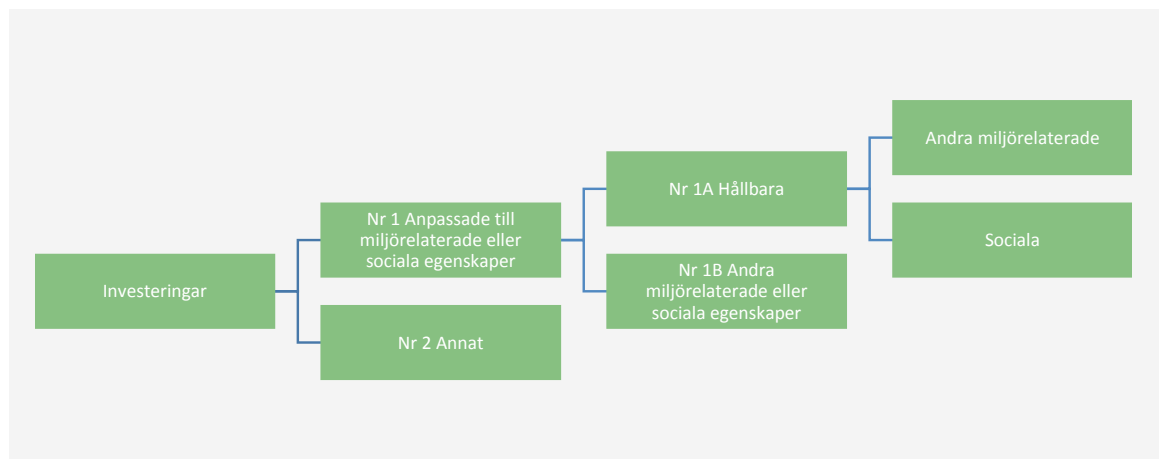


Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

● Vad var tillgångsallokeringen?

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.



Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper omfattar den finansiella produktens investeringar som används för att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten.

Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses som hållbara investeringar.

Kategorin **Nr 1 Anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar:

- Underkategorin **Nr 1A Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.

- Underkategorin **Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper** omfattar investeringar anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som inte anses vara hållbara investeringar.

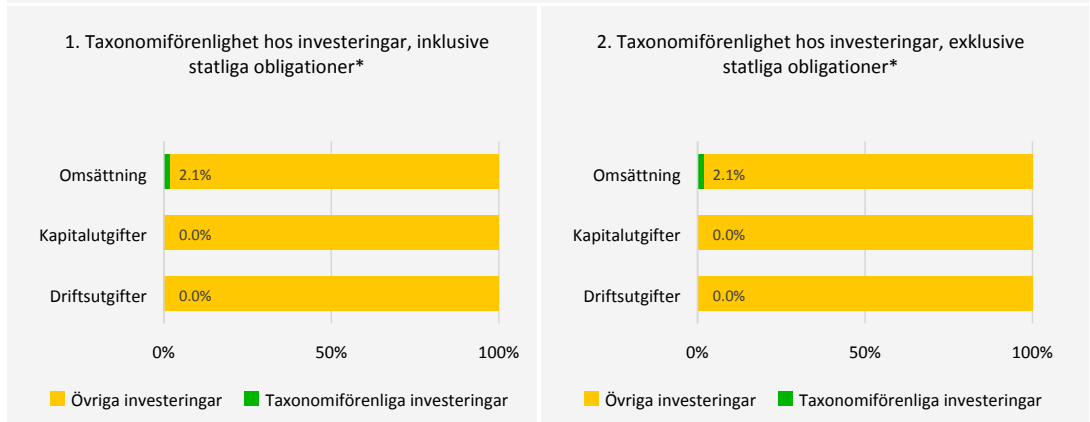
● I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.



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

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 statliga obligationer är*, visar den första grafen överensstämmelsen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar överensstämmelsen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



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

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

Andelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter är så pass låg i förhållande till fondens investeringar att det, med hänsyn till osäkerheter kopplade till datakvalitén, inte är meningsfullt att särredovisa detta.

● Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.



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

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.



är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt förordning (EU) 2020/852.



Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.



Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?

Det här avsnittet trädde i kraft 1 januari 2023, därför är det inte aktuellt att återrapportera på detta för 2022. Fonden kommer att återrapportera på detta i årsrapporteringen för 2023.



Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?

Hållbarhet är en av flera viktiga kvalitetsaspekter som vi tar hänsyn till i vår investeringsprocess, där vår ambition är att investera i företag bolag som tydligt integrerar hållbarhet i sin affärsmodell. Innehav som vi valt in mot den bakgrunden är bl.a. Atlas Copco, Nibe och Garo. Dessa företag bolag hjälper till med omställningen från fossila bränslen till mer miljövänliga och hållbara alternativ, vilket också bidrar till lägre utsläpp av växthusgaser. Fonden exkluderar företag bolag som inte når upp till fondbolagets strikta kriterier runt hållbarhet. Exempelvis exkluderas bolag som är aktiva inom kommersiell spelverksamhet där mer än 5 procent % av omsättningen kommer från produktion, distribution eller service av kommersiella spel om pengar. Ett sådant bolag är Evolution. Likaså exkluderas Swedish Match för att de är involverade i tobaksindustrin då mer än 5 % procent av deras omsättning kommer från distribution av tobak. Under perioden hade fonden haft ett flertal hållbarhetsdialoger med bland andra Atlas Copco, Lifco, Garo, Stora Enso, Elekta och Cary Group. Dessa dialoger kan vara proaktiva för att förbättra det generella hållbarhetsarbetet eller reaktiva för att försöka påverka en viss fråga där det är möjligt att företaget bolaget inte lever upp till internationella regler och riktlinjer. Dialogen med Atlas Copco täckte deras generella hållbarhetsarbete men specifika områden runt som mångfald och jämställdhet mellan könen samt ersättnings- och incitamentsprogram kopplat till hållbarhetsfaktorer togs också upp. Med Cary Group diskuterades vi EU taxonomin, miljöavtryck och återvinning av glas från vindrutor samt fördelarna med att ansluta till Science Based Targets Initiative (SBTi) vilket företaget bolaget i ett senare skede valde att göra. Hållbarhet kopplat till leveranskedjor, kopplingen mellan hållbarhet och ersättnings- och incitamentsprogram samt företags bolagets transparens kring hållbarhetsrapportering har haft särskilt fokus under perioden. Genom vårt ägarstyrningsarbete påverkar även fondbolaget bolagen via deltagande i valberedningar och röstar på bolagstämmor där vi är stora ägare eller där vår förvaltningsteamet har gjort en betydande investering.



Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

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

● Hur skiljer sig referensvärdet från ett brett marknadsindex?

Fonden använder sig inte av ett jämförelseindex för att uppnå sitt främjande av miljömässiga och sociala egenskaper

● Vilket resultat hade denna finansiella produkt när det gäller hållbarhetsindikatorerna för att bestämma referensvärdets anpassning till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas?

Fonden använder sig inte av ett jämförelseindex för att uppnå sitt främjande av miljömässiga och sociala egenskaper

● Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

Fonden använder sig inte av ett jämförelseindex för att uppnå sitt främjande av miljömässiga och sociala egenskaper

● Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med det breda marknadsindexet?

Fonden använder sig inte av ett jämförelseindex för att uppnå sitt främjande av miljömässiga och sociala egenskaper