

## Bilaga IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

**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.

**Produktnamn:** Swedish Sustainable Leaders **Identifieringskod för juridiska personer:** 549300HVY8KUGYTQIU97

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?**

<input checked="" type="radio"/> <input type="checkbox"/> Ja	<input type="radio"/> <input checked="" type="checkbox"/> Nej
<input type="checkbox"/> Den gjorde <b>hållbara investeringar med ett miljömål:</b> ___% <ul style="list-style-type: none"><li><input type="checkbox"/> i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin</li><li><input type="checkbox"/> i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin</li></ul>	<input type="checkbox"/> Den <b>främjade miljörelaterade och sociala egenskaper</b> 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"><li><input type="checkbox"/> med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin</li><li><input type="checkbox"/> med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin</li><li><input type="checkbox"/> med ett socialt mål</li></ul>
<input type="checkbox"/> Den gjorde <b>hållbara investeringar med ett socialt mål:</b> ___%	<input checked="" type="checkbox"/> Den främjade 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 förvaltades ur ett mångdimensionellt och dynamiskt förhållningssätt vid främjandet av miljörelaterade och sociala egenskaper. Fonden främjade miljörelaterade och sociala egenskaper genom att premiera investeringar i bolag som är ledande inom hållbarhet. Miljörelaterade egenskaper främjades genom att fonden i sin förvaltningsmodell premierade bolag med tex låga koldioxidutsläpp. Sociala egenskaper främjades genom att fonden i sin

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

förvaltningsmodell exkluderade bolag som tex inte lever upp till krav på mänskliga rättigheter samt premierade bolag med god jämställdhet.

**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.

● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Förvaltaren använder ett kvantitativt ramverk kallat Sustainability Cube™ för att utvärdera fondens univers. Det mynnar ut i följande hållbarhetsindikatorer:

	<b>Avg Score</b>
Klimatomställning	7,32
Branschledare inom ESG	7,67
Anpassning till UN SDG	6,18
<b>Tot Score</b>	<b>6,99</b>

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

Fondens förvaltare beaktade huvudsakliga negativa effekter på hållbarhetsfaktorer genom att sträva efter att exkludera bolag som medvetet och upprepat bryter mot internationella normer och konventioner enligt UN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag samt bolag verksamma inom sektorer med förhöjd hållbarhetsrisk i enlighet med fondens hållbarhetspolicy.

**Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?**

<b>Största investeringarna</b>	<b>Sektor</b>	<b>% tillgångar</b>	<b>Land</b>
Nordea Bank Abp	Financials	5,2%	FI
Skandinaviska Enskilda Banken	Financials	5,0%	SE
Volvo AB	Industrials	4,9%	SE
Investor AB	Financials	4,8%	SE
Atlas Copco AB	Industrials	4,3%	SE
Kinnevik AB	Financials	3,9%	SE
Tele2 AB	Communications	3,8%	SE
Nibe Industrier AB	Industrials	3,7%	SE
EQT AB	Financials	3,7%	SE
Telefonaktiebolaget LM Ericsson	Technology	3,7%	SE
Epiroc AB	Industrials	3,6%	SE
Svenska Handelsbanken AB	Financials	3,3%	SE
Svenska Cellulosa AB SCA	Materials	3,1%	SE
Alfa Laval AB	Industrials	2,7%	SE
Swedbank AB	Financials	2,6%	SE

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

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

## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har inte gjort några hållbara investeringar.

- **Vad var tillgångsallokeringen?**

99% av fondens medel investerades i fonder som i sin tur främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper. Resterande 1% utgjordes av investeringar som ej anses främja miljörelaterade eller sociala egenskaper samt i likvida medel. 100% av fondens investeringar anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper klassades som "Nr 1B Andra miljörelaterade eller sociala egenskaper".

**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 verken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses som hållbara investeringar.



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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla 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 verksamheter** som det ännu inte finns koldioxidsnåla alternativ tillgängliga för och som har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

- **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 - Wireless Telecommunications	6,1%
Consumer Discretionary - Auto Parts	0,7%
Consumer Discretionary - Specialty Apparel Stores	1,2%
Consumer Discretionary - Sporting Goods	1,6%
Consumer Staples - Food & Drug Stores	2,1%
Consumer Staples - Personal Care Products	1,5%
Financials - Banks	16,1%
Financials - Investment Companies	8,8%
Financials - Private Equity	3,7%
Health Care - Biotech	0,8%
Health Care - Health Care Supplies	2,3%
Health Care - Large Pharma	2,4%
Health Care - Medical Equipment	2,0%
Industrials - Agricultural Machinery	2,3%
Industrials - Commercial Vehicles	4,9%

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.

Industrials - Comml & Res Bldg Equip & Sys	6,0%
Industrials - Construction & Mining Machinery	5,1%
Industrials - Diversified Industrials	2,7%
Industrials - Electrical Components	2,4%
Industrials - Flow Control Equipment	4,3%
Industrials - Industrial Wholesale & Rental	1,8%
Industrials - Measurement Instruments	2,3%
Industrials - Rubber & Plastic	4,8%
Materials - Base Metals	1,5%
Materials - Containers & Packaging	3,4%
Real Estate - Multi Asset Class Own & Develop	1,8%
Real Estate - Office Owners & Developers	2,4%
Technology - Application Software	1,0%
Technology - Communications Equipment	3,7%

Resterande placeringar var kassarelaterade placeringar.



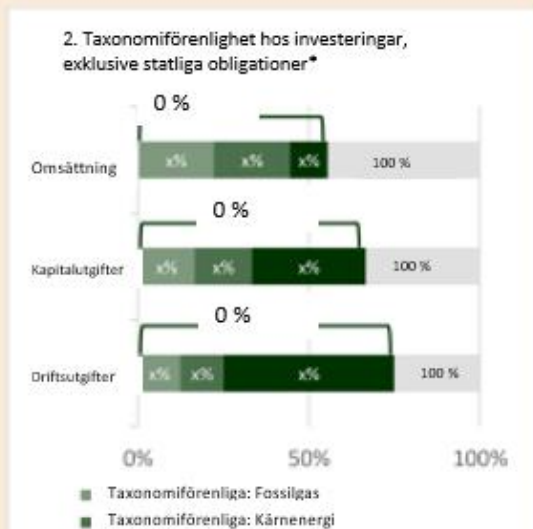
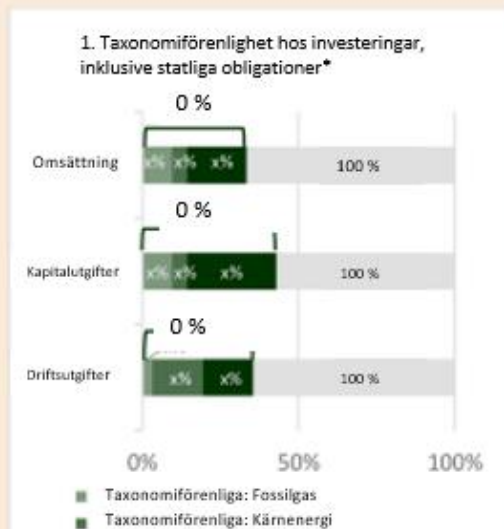
### I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?

Fonden gjorde inga hållbara investeringar med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin.

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

Ja:  
 I fossilgas |  kärnenergi  
 Nej

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.



•

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

Fonden gjorde inga investeringar i omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.



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

Syftet med investeringarna som inkluderades i kategorin "annat" var att effektivisera portföljförvaltning, likviditetsförvaltning och säkringsändamål. I fonden var dessa investeringar likvida medel samt derivat. Då likvida medel och derivat 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 inte bröt mot internationella normer enligt UN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

I enlighet med fondens exkluderingspolicy strävade fondens underliggande förvaltare efter att inte investera i bolag verksamma inom branscher med stor risk för negativa hållbarhetseffekter.

Fonden investerade endast i fonder som själva främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper.