



Hållbarhets- redovisning 2020

Bilaga till Årsberättelse 2020

Innehåll

Hållbarhet inom SPP Fonder	3	SPP Aktiefond Stabil.....	34
SPP Aktiefond Europa	6	SPP Generation 40-tal.....	36
SPP Aktiefond Global	8	SPP Generation 50-tal.....	38
SPP Aktiefond Japan	10	SPP Generation 60-tal.....	40
SPP Aktiefond Sverige	12	SPP Generation 70-tal.....	42
SPP Aktiefond USA	14	SPP Generation 80-tal.....	44
SPP Emerging Markets SRI	16	SPP Mix 20.....	46
GodFond Sverige & Världen	18	SPP Mix 50.....	48
SPP Europa Plus	20	SPP Mix 80	50
SPP Emerging Markets Plus	22	SPP Mix 100	52
SPP Global Plus	24	SPP Korträntefond	54
SPP Sverige Plus.....	26	SPP Obligationsfond	56
SPP Sverige Småbolag Plus.....	28	SPP Grön Obligationsfond	58
SPP Global Multifactor Plus.....	30	SPP FRN Företagsobligationsfond	60
SPP Global Solutions.....	32	SPP Global Företagsobligation Plus	62
		SPP High Yield Företagsobligation	64

Hållbarhet inom SPP Fonder

SPP Fonder AB är ett helägt dotterbolag till Storebrand Asset Management AS, som i sin tur ägs av Storebrand ASA. Vi är pionjärer inom hållbar kapitalförvaltning och alla våra fonder förvaltas med höga hållbarhetskrav i syfte att skapa mesta möjliga värde för våra sparare. Våra produkter och investeringslösningar ska vara prisvärda och enkelt kunna användas som byggstenar i en sparportfölj. Vi är även övertygade om att de bolag som är rustade att möta skärpta krav på hållbarhet är de som kommer att öka mest i värde.

Gedigen erfarenhet

Storebrands hållbarhetsteam etablerades redan 1995 och arbetar helt integrerat i kapitalförvaltningen. Under 2019 delades hållbarhetsteamet upp i ett Solutionsteam och ett Risk- och ägarstyrningsteam. De består av medarbetare med ett antal olika specialistkompetenser och arbetar helt integrerat i kapitalförvaltningen för samtliga tillgångsslag, och bistår förvaltarteamen med kunskap och perspektiv som skapar bättre förutsättningar för att kunna ta långsiktigt kloka investeringsbeslut.

Vår analys

För att säkerställa långsiktig avkastning arbetar vi systematiskt med att successivt flytta investeringar till mer hållbara företag, projekt och tillgångar. Vi väljer – och överviktar – företag som genom sina tjänster, produkter eller tekniker bidrar i omställningen till ett mer hållbart samhälle.

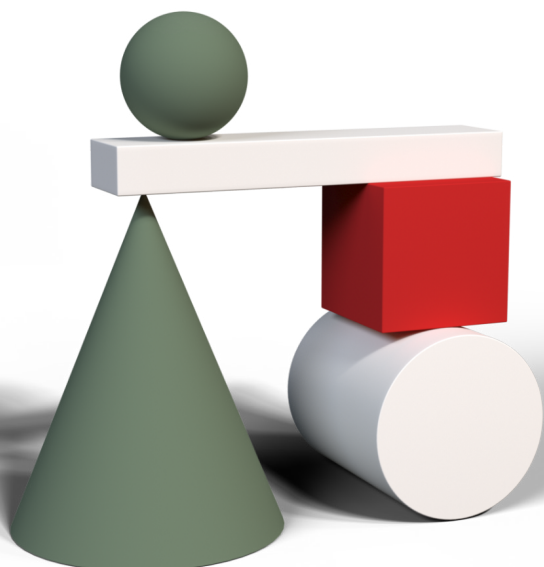
Vi har daglig kontroll på samtliga innehav för att fånga upp om ett bolag bryter mot våra hållbarhetskriterier. Våra innehav screenas därutöver 4 gånger per år.

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egenutvecklade hållbarhetsrating.

Hos oss är hållbarhetsanalysen en central del i kapitalförvaltningen och det löfte vi ger till våra kunder. Hållbarhetsarbetet är helt integrerat i vår förvaltningsmodell. Samtliga förvaltare, inom alla tillgångsslag, har tillgång till hållbarhetsdata för över 4 500 bolag. Strategin för hållbara investeringar bygger på tre metoder: exkludera, inkludera och aktivt påverka. En metod löser inte allt, det krävs kombinerade insatser för bestående förändring.

En hållbarhetsrating mellan 0 och 100 ges till samtliga cirka 4 500 bolag i vårt investeringsuniversum, det vill säga de bolag vi kan investera i. Vi bedömer i ett första steg bolagens exponering mot finansiellt relevanta hållbarhetsrisker. Vi kompletterar sedan riskkartläggningen med en värdedriven möjlighetsanalys, som utgår från hur väl bolagen är positionerade – genom sina tjänster, produkter eller tekniker – i förhållande till FNs globala hållbarhetsmål och Parisavtalet. Genom att identifiera både risker och möjligheter kopplade till ESG-faktorer och FNs Globala Hållbarhetsmål kan vi på ett effektivt sätt identifiera bolag som bidrar till att lösa de hållbarhetsutmaningar världen står inför. Förvaltarteamen använder sig sedan av ratingen på olika sätt beroende på investeringsstrategi

Det är vår övertygelse att bolag som har förståelse för och integrerar hållbarhetsaspekter i sin affärsstrategi kommer att visa upp en starkare utveckling över tid än jämförbara bolag som inte tar hänsyn till detta. Att investera hållbart är därför av yttersta vikt för att uppnå bästa möjliga riskjusterade avkastning för våra andelsägare.



En strategi – tre metoder

Hållbarhet är en central del i vår kapitalförvaltning och i det löfte vi ger till våra kunder. Vår strategi för hållbara investeringar bygger på tre metoder: exkludera, inkludera och aktivt påverka. En metod löser inte allt, det krävs kombinerade insatser för bestående förändring.

Välja bort

Det är av fundamental betydelse att bolagen vi investerar i följer internationella lagar, normer och konventioner. Vår metod för exkluderingar är omfattande och våra förvaltare kan inte välja exkluderade bolag när de investerar i aktier eller obligationer. Vi delar in våra exkluderingar i normbaserade och produktbaserade.



Normbaserade exkluderingar innebär att vi väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner, det omfattar:

- Mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt
- Korruption och ekonomisk brottslighet
- Allvarlig miljö- och klimatskada inklusive ohållbar palmolja
- Kontroversiella vapen (klusterbomber, personminor, kärnvapen, kemiska- och biologiska vapen)

Produktbaserade exkluderingar innebär att vi väljer bort bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution från:

- Vapen och krigsmateriel
- Fossila bränslen (kol, olja, gas, oljesand m.m.)
- Tobak
- Cannabis (för icke-medicinskt bruk)
- Alkohol
- Kommersiell spelverksamhet
- Pornograf
- Bolag med stora fossilreserver (mer än 100 miljoner ton koldioxid i fossila reserver)

SPP Grön Obligationsfond har särskilda fossilkriterier och väljer bort samtliga bolag i Sektor 10, Energi, (utvinning av kol, olja och gas), och bolag vars omsättning till mer än 50 procent kommer från produktion och/eller distribution av fossila bränslen i övriga sektorer. Skälet till att ha en omsättningsgräns på 50 istället för 5 procent är att gröna obligationer ska ha möjlighet att bidra till omställning i branscher som historiskt sett varit fossilberoende.

Vi väljer bort länder/stater – statsobligationer utgivna av stater/länder som systematiskt och grovt försummar grundläggande sociala och politiska rättigheter eller som omfattas av sanktioner som införts av FNs säkerhetsråd.

Välja in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår hållbarhetsrating. Syftet med ratingen är att integrera ESG-aspekter (miljö-, sociala frågor samt bolagsstyrning) och FNs globala hållbarhetsmål i alla investeringar, faktorer som vi anser skapar goda förutsättningar för långsiktig avkastning. Vår analys, av cirka 4 500 bolag, och det sammanlagda hållbarhetsbetyget integreras systematiskt i alla investeringsprocesser.



I ett antal fonder investeras det mer i så kallade lösningsbolag, som vi definierar som bolag vars produkter och/eller tjänster bidrar till att uppnå målen för global hållbar utveckling. För oss är det viktigt att investera brett inom olika tekniker, exempelvis gröna transporter, förnybar energi, vatten, återvinning m.m., för att diversifiera oss när det gäller risker och att ta vara på möjligheter.

Påverka

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar.



Av vårt totala hållbarhetsarbete utgör aktivt ägarskap en betydande del. Vår målsättning är att ge bästa möjliga riskjusterade avkastning till våra kunder samtidigt som vi förbättrar bolagen vi investerar i utifrån ett hållbarhetsperspektiv.

Inom viktiga områden har vi en pågående dialog med bolagen i fonderna. Det kan röra sig om allt ifrån bolagsstyrning till sociala eller miljörelaterade frågor. Dialogerna är viktiga för att vi ska kunna avgöra om ett bolags verksamhet är ansvarsfull och levererar hållbar avkastning till våra kunder.

För att vi ska lyckas med vårt arbete inom aktivt ägarskap måste det finnas en nära koppling mellan de dialoger som förs samt exkluderingar. Därav fortsätter vi ofta att föra dialog med bolagen som vi exkluderat för att utmana dem att utvecklas vidare och kunna investera i dem igen när de visat på framsteg. Vi prioriterar också att lägga resurser på bredare samarbeten inom investerargrupper och forum som finns tillgängliga via bland annat UNPRI, Climate Action 100+, FAIRR m.fl.

Med tanke på att vissa hållbarhetsfrågor, som klimatförändringar, inte kan lösas av investerare och bolag ensamma, uttrycker vi också våra åsikter om dessa pressande frågor till regeringar och myndigheter.

Genom samarbete bidrar vi till att både förbättra de individuella bolagen och till att förflytta normer och åstadkomma bestående förändring. Det är nyckeln till långsiktigt framgångsrik kapitalförvaltning.

Vi använder vår rösträtt på bolagsstämmor i där vi har ett betydande ägande. Många av de bolag vi investerar i finns utanför våra hemmamarknader, därför använder vi oss av global ombudsöstning. Då röstar vi elektroniskt via fullmakt (så kallad proxy voting) då kan vi vara aktiva ägare utan fysisk närvaro.

Koldioxidavtryck

Klimatfrågan är en av näringslivets viktigaste utmaningar. Det ligger därför både i institutionella och enskilda investerares intresse att klimateffekter mäts och hanteras på ett klokt sätt.

SPP/Storebrand skrev 2015 under två internationella initiativ med fokus på att redovisa och sänka koldioxidintensiteten för aktieinvesteringar: Montreal Pledge montrealpledge.org och Portfolio Decarbonisation Coalitionunepfi.org/pdc. Att successivt minska vår exponering i fossilt innehav och styra om kapitalet till bolag som bidrar till lösningar på klimatproblemet vi står inför är en självklarhet för oss.

Du hittar våra rapporter om CO₂-avtryck och exkluderingar på sppfonder.se/rapporter

Koldioxidavtryck – en ögonblicksbild

Koldioxidavtrycket visar en historisk ögonblicksbild av hur utsläppen från företagen i fondens aktieportfölj ser ut. Värdena kommer att variera i takt med att företagens utsläpp förändras, men också genom att portföljens sammansättning ändras. Även växelkursförändringar påverkar mätningen.

Observera att koldioxidavtrycket inte visar investeringarnas totala klimatpåverkan, bland annat för att:

- Endast vissa utsläpp inkluderas. Indirekta utsläpp från leverantörer omfattas inte alltid av beräkningarna och inte heller de vanligtvis omfattande utsläpp som kan följa på användningen av ett företags produkter
- Utsläppsdata från företag inte är fullständig
- Endast vissa tillgångsslag mäts
- Besparingar av utsläpp genom produkter och tjänster inte räknas in
- Information om fossila reserver inte ingår
- Måttet inte säger något om hur väl en portfölj är positionerad mot, eller dess bidrag till, en övergång till ett koldioxidsnålt samhälle

Koldioxidavtrycket visar en ögonblicksbild av hur aktieportföljens koldioxidavtryck ser ut. Beräkningarna är inte heltäckande och indirekta utsläpp omfattas inte. Måttet säger ingenting om hur portföljen bidrar till ett koldioxidsnålt samhälle. Mer om måttet går att läsa på sppfonder.se

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida utveckling. De pengar som placeras i fonder kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta beloppet. På sppfonder.se hittar du faktablad och informationsbroschyrer. Alla våra fonder förvaltas enligt en hållbarhetsstrategi som bygger på metoderna Välja in, Välja bort och Påverka, för mer information se sppfonder.se/hallbarhet



Åsa Wallenberg,
Vd SPP Fonder AB

Vår vision är att vara ledande inom hållbara investeringar. Vi ska skapa god riskjusterad avkastning för våra kunder utan att kompromissa med kommande generationers möjlighet att möta sina egna behov. Vi vill uppnå detta genom att driva utveckling inom hållbar kapitalförvaltning, påverka bolagen vi investerar i och styra om kapitalströmmarna mot bolag som har eller söker lösningar på de hållbarhetsutmaningar som världen står inför.

SPP Aktiefond Europa

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Aktiefond Europa har i grunden en exkluderingsstrategi och väljer in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag med mer hållbara

bolag. Detta medför att fonden har 10,2 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens koldioxidavtryck är 10,61 och fondens jämförelseindex har 13,49*.

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 83 av det underliggande indexets 421 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar vår exkluderingslista kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 61 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 76 bolagsstämmor.

SPP Aktiefond Global

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0–100.

SPP Aktiefond Global har i grunden en exkluderingsstrategi och väljer in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag med mer hållbara

bolag. Detta medför att fonden har 10,6 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens koldioxidavtryck är 10,37 och fondens jämförelseindex har 15,06*.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

- Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 517 av det underliggande indexets 2 908 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

- Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

- Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 179 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 299 bolagsstämmor.

SPP Aktiefond Japan

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Aktiefond Japan har i grunden en exkluderingsstrategi och väljer in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag med mer hållbara

bolag. Detta medför att fonden har 4,3 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens koldioxidavtryck är 7,61 och fondens jämförelseindex har 7,58*.

Fondens hållbarhetsnivå är 5/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 34 av det underliggande indexets 301 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 19 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 7 bolagsstämmor.

SPP Aktiefond Sverige

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Aktiefond Sverige har i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag med mer

hållbara bolag. Detta medför att fonden har 1,9 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens koldioxidavtryck är 4,40 och fondens jämförelseindex har 3,64*.

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 7 av det underliggande indexets 98 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 22 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 21 bolagsstämmor.

SPP Aktiefond USA

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Aktiefond USA har i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag med mer

hållbara bolag. Detta medför att fonden har 10,4 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens koldioxidavtryck är 8,12 och fondens jämförelseindex har 13,19*.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 106 av det underliggande indexets 613 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 49 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 145 bolagsstämmor.

SPP Emerging Markets SRI

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Emerging Markets SRI har i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag med mer

hållbara bolag. Detta medför att fonden har 9,3 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens koldioxidavtryck är 20,79 och fondens jämförelseindex har 29,95*.

Fondens hållbarhetsnivå är 5/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 223 av det underliggande indexets 1 344 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 32 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 42 bolagsstämmor.

GodFond Sverige & Världen

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

GodFond Sverige & Världen har i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag med mer

hållbara bolag Detta medför att fonden har 10 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens koldioxidavtryck är 8,36 och fondens jämförelseindex har 11,17*.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

Klusterbomber, personminor

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

Kärnvapen

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

Vapen och/eller krigsmaterial

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Alkohol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Tobak

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

Kommersiell spelverksamhet

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Pornografi

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 524 av det underliggande tre indexens 3 006 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 122 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 137 bolagsstämmor.

SPP Europa Plus

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Varje enskilt bolag som väljs in i fonden bedöms och betygsätts utifrån vår fundamentala hållbarhetsanalys. Urvalet av bolag sker i flera steg där de viktigaste parametrarna är välja in bolag med lågt CO₂-avtryck, lösningsbolag (bolag med lösningar på världens hållbarhetsutmaningar) och bolag med höga betyg från vår analys.
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

Upp till 10 procent av fonden kan placeras lösningsbolag. Det är bolag med lösningar och/eller tjänster som bidrar till att uppnå

målen för hållbar utveckling. För oss är det viktigt att investera brett inom olika tekniker, exempelvis gröna transporter, cirkulär ekonomi och förnybar energi. Vi har 68 lösningsbolag i SPP Europa Plus.

Fondens koldioxidavtryck är 6,71 och fondens jämförelseindex har 13,49*. Fonden har 16,3 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 83 av det underliggande indexets 421 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 61 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 58 bolagsstämmor.

SPP Emerging Markets Plus

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Varje enskilt bolag som väljs in i fonden bedöms och betygsätts utifrån vår fundamentala hållbarhetsanalys. Urvalet av bolag sker i flera steg där de viktigaste parametrarna är välja in bolag med lågt CO₂-avtryck, lösningsbolag (bolag med lösningar på världens hållbarhetsutmaningar) och bolag med höga betyg från vår analys.
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

Upp till 10 procent av fonden kan placeras lösningsbolag. Det är bolag med lösningar och/eller tjänster som bidrar till att uppnå

målen för hållbar utveckling. För oss är det viktigt att investera brett inom olika tekniker, exempelvis gröna transporter, cirkulär ekonomi och förnybar energi. Vi har 37 lösningsbolag i SPP Emerging Markets Plus.

Fondens koldioxidavtryck är 9,13 och fondens jämförelseindex har 29,95*. Fonden har 16,3 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 223 av det underliggande indexets 1 344 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 27 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 40 bolagsstämmor.

SPP Global Plus

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Varje enskilt bolag som väljs in i fonden bedöms och betygsätts utifrån vår fundamentala hållbarhetsanalys. Urvalet av bolag sker i flera steg där de viktigaste parametrarna är välja in bolag med lågt CO₂-avtryck, lösningsbolag (bolag med lösningar på världens hållbarhetsutmaningar) och bolag med höga betyg från vår analys.
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

Upp till 10 procent av fonden kan placeras lösningsbolag. Det är bolag med lösningar och/eller tjänster som bidrar till att uppnå

målen för hållbar utveckling. För oss är det viktigt att investera brett inom olika tekniker, exempelvis gröna transporter, cirkulär ekonomi och förnybar energi. Vi har 147 lösningsbolag i SPP Sverige Plus.

Fondens koldioxidavtryck är 4,82 och fondens jämförelseindex har 13,49*. Fonden har 20,8 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex .

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

- Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 294 av det underliggande indexets 1 564 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

- Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

- Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 96 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 191 bolagsstämmor.

SPP Sverige Plus

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**

- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Varje enskilt bolag som väljs in i fonden bedöms och betygsätts utifrån vår fundamentala hållbarhetsanalys. Urvalet av bolag sker i flera steg där de viktigaste parametrarna är välja in bolag med lågt CO₂-avtryck, lösningsbolag (bolag med lösningar på världens hållbarhetsutmaningar) och bolag med höga betyg från vår analys.

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**
Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

Upp till 10 procent av fonden kan placeras lösningsbolag. Det är bolag med lösningar och/eller tjänster som bidrar till att uppnå

målen för hållbar utveckling. För oss är det viktigt att investera brett inom olika tekniker, exempelvis gröna transporter, cirkulär ekonomi och förnybar energi. Vi har 56 lösningsbolag i SPP Sverige Plus.

Fondens koldioxidavtryck är 4,68 och fondens jämförelseindex har 4,53*. Fonden har 5,7 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex .

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 19 av det underliggande indexets 337 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 30 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 39 bolagsstämmor.

SPP Sverige Småbolag Plus

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Varje enskilt bolag som väljs in i fonden bedöms och betygssätts utifrån vår fundamentala hållbarhetsanalys. Urvalet av bolag sker i flera steg där de viktigaste parametrarna är välja in bolag med lågt CO₂-avtryck, lösningsbolag (bolag med lösningar på världens hållbarhetsutmaningar) och bolag med höga betyg från vår analys.
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

Upp till 10 procent av fonden kan placeras lösningsbolag. Det är bolag med lösningar och/eller tjänster som bidrar till att uppnå

målen för hållbar utveckling. För oss är det viktigt att investera brett inom olika tekniker, exempelvis gröna transporter, cirkulär ekonomi och förnybar energi. Vi har 43 lösningsbolag i SPP Sverige Småbolag Plus.

Fondens koldioxidavtryck är 4,66 och fondens jämförelseindex har 6,00*. Fonden har 1,9 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi och cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 9 av det underliggande indexets 276 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 12 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Fonden startades under hösten 2020 och vi har inte röstat på några bolagsstämmor för SPP Sverige Småbolag Plus för 2020.

SPP Global Multifactor Plus

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

Fonden väljer in bolag utifrån fyra olika faktorstrategier; värde, storlek, momentum och volatilitet.

SPP Global Multifactor Plus optimerar (väljer in) bolag som har hög rating i vår hållbarhetsanalys, cirka 250 – 350 bolag, från ett urval på cirka 1 600 bolag.

Fondens koldioxidavtryck är 8,05 och fondens jämförelseindex har 13,49*. Fonden har 4,2 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 294 av det underliggande indexets 1 564 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 24 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 61 bolagsstämmor.

SPP Global Solutions

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål. Fonden väljer in bolag som drar nytta av fyra identifierade trender: lägre klimatpåverkan och resursanvändning, smarta städer som kombinerar större befolkning med lägre miljö- och klimatpåverkan, smarta produkter som bidrar till ett mer effektivt och ekonomi..

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in
SPP Global Solutions väljer in bolag som drar nytta av fyra identifierade trender; lägre klimatpåverkan och resursanvändning, smarta städer som kombinerar större befolkning med lägre miljö- och klimatpåverkan, smarta produkter som som gör det möjligt även för fattiga konsumenter att förbättra sin livssituation och ekonomi.

Fonden har 71 innehav varav vi under 2020 bland annat valt in Vodacom, Visa, Giant, Sekisui, West Holdings, Xinyi Solar Holdings, Enphase Energy, CrowdStrike, Okta Inc, Palo Alto, EDP Renovaveis SA, Comfort Systems USA, Bravida och Badger Meter.

Här kan du se innehaven i fonden: sppfonder.se/portfolj

Fondens koldioxidavtryck är 9,20 och fondens jämförelseindex har 15,06*. Fonden har 51,1 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 9/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

- Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 517 av det underliggande indexets 2 908 bolag exkluderade.

Under 2020 har vi exkluderat First Solar Inc och Siemens Gamesa Renewable Energy SA på grund av fondens exkluderingskriterier. Fonden väljer aktivt in hållbara bolag.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

- Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

- Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 5 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 9 bolagsstämmor.

SPP Aktiefond Stabil

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FN:s hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Aktiefond Stabil väljer in bolag med högt hållbarhetsbetyg. Fondens har en viss preferens för aktier med hög direktavkastning.

Fondens koldioxidavtryck är 8,22 och fondens jämförelseindex är 13,49*. Fonden har 14,6 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 294 av det underliggande indexets 1 564 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 21 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 46 bolagsstämmor.

SPP Generation 40-tal

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Generation 40-tal har i aktiedelen, i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag

med mer hållbara bolag. På räntesidan har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av Rikshem, Svenska Staten Grön, LKAB.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 521 av det olika underliggande indexens 2 947 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 150 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 236 bolagsstämmor.

SPP Generation 50-tal

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Generation 50-tal har i aktiedelen, i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag

med mer hållbara bolag. På räntesidan har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av Vasakronan, SPB 1 Boligkredit.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 521 av det olika underliggande indexens 2 947 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 154 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 264 bolagsstämmor.

SPP Generation 60-tal

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Generation 60-tal har i aktiedelen, i grunden en exkluderings-strategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag

med mer hållbara bolag. På räntesidan har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av Rikshem och Svenska Staten Grön.

Fondens koldioxidavtryck är 7,97 och fondens jämförelseindex har 11,42*. Fonden har 6 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fonden har hållbarhetsnivå 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

- Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 521 av det olika underliggande indexens 2 947 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

- Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

- Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 153 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 265 bolagsstämmor.

SPP Generation 70-tal

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Generation 70-tal har i aktiedelen, i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag

med mer hållbara bolag. På räntesidan har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av KfW.

Fondens koldioxidavtryck är 8,28 och fondens jämförelseindex har 11,53*. Fonden har 6 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 521 av det olika underliggande indexens 2 947 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på [sppfonder.se/rapporter](https://www.sppfonder.se/rapporter)

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 153 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 266 bolagsstämmor.

SPP Generation 80-tal

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Generation 80-tal har i aktiedelen, i grunden en exkluderingsstrategi och väljer enbart in (optimerar) hållbara bolag enligt vår hållbarhetsanalys och därmed ersätter vi exkluderade bolag

med mer hållbara bolag. På räntesidan har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av KfW.

Fondens koldioxidavtryck är 8,56 och fondens jämförelseindex har 11,53*. Fonden har 6 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fonden hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 521 av det olika underliggande indexens 2 947 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 150 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden. Vi röstar i allmänhet på bolagsstämmor där vi har ett betydande ägande, i frågor som bedöms vara i andelsägarnas intresse samt i frågor som inte är i linje med vår ägarstyrningspolicy. Under 2020 röstade vi på 231 bolagsstämmor.

SPP Mix 20

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affäretiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden är in en fond-i-fond och placerar huvudsakligen i fonder inom Storebrand-koncernen.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Fonden är en Fond-i-Fond och väljer in hållbara fonder med ambitiösa hållbarhetskriterier. Fonder som väljs in skall minst följa SPP Fonders norm- och produktbaserade hållbarhetskriterier.

SPP Mix 20 har under året bland annat valt in fonden: SPP High Yield Företagsobligation, SPP Sverige Småbolag Plus, SPP Global Multifactor Plus och Delphi Green Trends.

Fonden har 14 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.
- Fossila bränslen (olja, kol, gas)**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Kol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har vi exkluderat fonden SPP Aktiefond Stabil.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affäretik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en Fond-i-Fond och påverkansarbetet sker i de underliggande fonderna.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

För Mix 20 har vi inte något eget påverkansarbete. Det sker i de underliggande fonderna. När det gäller Storebrandkoncernens egna fonder använder vi oss av dialog och aktivt ägarskap för att påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

SPP Mix 50

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affäretiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden är in en fond-i-fond och placerar huvudsakligen i fonder inom Storebrand-koncernen.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Fonden är en Fond-i-Fond och väljer in hållbara fonder med ambitiösa hållbarhetskriterier. Fonder som väljs in skall minst följa SPP Fonders norm- och produktbaserade hållbarhetskriterier.

SPP Mix 50 har under året vi bland annat valt in fonderna: SPP High Yield Företagsobligation, SPP Sverige Småbolag Plus och Delphi Green Trends.

Fonden har 10 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fonders hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.
- Fossila bränslen (olja, kol, gas)**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Kol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har vi exkluderat fonden SPP Aktiefond Stabil.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affäretik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en Fond-i-Fond och påverkansarbetet sker i de underliggande fonderna.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

För Mix 50 har vi inte något eget påverkansarbete. Det sker i de underliggande fonderna. När det gäller Storebrandkoncernens egna fonder använder vi oss av dialog och aktivt ägarskap för att påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

SPP Mix 80

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden är in en fond-i-fond och placerar huvudsakligen i fonder inom Storebrand-koncernen.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Fonden är en Fond-i-Fond och väljer in hållbara fonder med ambitiösa hållbarhetskriterier. Fonder som väljs in skall minst följa SPP Fonders norm- och produktbaserade hållbarhetskriterier.

SPP Mix 80 har under året vi bland annat fonderna: SPP High Yield Företagsobligation, SPP Sverige Småbolag Plus och Delphi Green Trends.

Fondens koldioxidavtryck är 7,71 och fondens jämförelseindex har 10,17*. Fonden har 12,2 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fonden hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.
- Fossila bränslen (olja, kol, gas)**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Kol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen (kontroversiella och konventionella), tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen samt bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har vi exkluderat fonden SPP Aktiefond Stabil.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en Fond-i-Fond och påverkansarbetet sker i de underliggande fonderna.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

För Mix 80 har vi inte något eget påverkansarbete. Det sker i de underliggande fonderna. När det gäller Storebrandkoncernens egna fonder använder vi oss av dialog och aktivt ägarskap för att påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

SPP Mix 100

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden är in en fond-i-fond och placerar huvudsakligen i fonder inom Storebrand-koncernen.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Fonden är en Fond-i-Fond och väljer in hållbara fonder med ambitiösa hållbarhetskriterier. Fonder som väljs in skall minst följa SPP Fonders norm- och produktbaserade hållbarhetskriterier.

SPP Mix 100 har under året bland annat val in fonderna: SPP Sverige Småbolag Plus och Delphi Green Trends.

Fondens koldioxidavtryck är 7,94 och fondens jämförelseindex har 12,33*. Fonden har 14,6 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fonden hållbarhetsnivå är 7/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.
- Fossila bränslen (olja, kol, gas)**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Kol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, Ilvarlig klimat- och miljöskada. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen (kontroversiella och konventionella), tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen samt bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har vi exkluderat fonden SPP Aktiefond Stabil.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en Fond-i-Fond och påverkansarbetet sker i de underliggande fonderna.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

För Mix 100 har vi inte något eget påverkansarbete. Det sker i de underliggande fonderna. När det gäller Storebrandkoncernens egna fonder använder vi oss av dialog och aktivt ägarskap för att påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

SPP Korträntefond

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Korträntefond är en aktivt förvaltd räntefond och väljer in bolag som rankas högt i vår hållbarhetsanalys. Varje investering

ska en hög kreditrating, Investment Grade med rating BBB- eller högre.

Under 2020 har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av Vacse, City of Malmö och City of Västerås

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har exkluderat ett nytt bolag med anledning av fondens exkluderingskriterier.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en räntefond och investerar i räntebärande värdepapper som exempelvis statsobligationer, bostadsobligationer och företagscertifikat. Räntefonder har inget aktieinnehav vilket innebär att fondbolaget inte kan rösta på bolagsstämor, men i övrigt kan fondbolaget påverka i hållbarhetsfrågor.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 44 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden.

SPP Obligationsfond

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag/emittenter som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Obligationsfond är en aktivt förvaltd räntefond och väljer in bolag som rankas högt i vår hållbarhetsanalys. Varje investering

ska en hög kreditrating, Investment Grade med rating BBB- eller högre.

Under 2020 har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av Kommuninvest, Svenska Staten Grön och DNB Boligkredit.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

- Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi, cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har exkluderat ett nytt bolag med anledning av fondens exkluderingskriterier.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en räntefond och investerar i räntebärande värdepapper som exempelvis statsobligationer, bostadsobligationer och företagscertifikat. Räntefonder har inget aktieinnehav vilket innebär att fondbolaget inte kan rösta på bolagsstämor, men i övrigt kan fondbolaget påverka i hållbarhetsfrågor.

- Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 44 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden.

SPP Grön Obligationsfond

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affäretiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar: Fonden investerar i certifierade hållbara obligationer. Målsättningen är att identifiera bolag med ett behov av finansiering som bidrar till en hållbar utveckling. Analys av bolagens/emittentens syfte med finansieringen är avgörande för valet av investeringar i fonden.
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar:

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

SPP Grön Obligationsfond är en aktivt förvaltd fond och som investerar i gröna obligationer, instrument med uttalade hållbarhetsteman som har klart positiv effekt på miljö och samhälle. Varje projekts hållbarhet verifieras av tredje part. Varje bolag som ger ut gröna obligationer måste passera våra hållbarhets-kriterier. Teman kan vara förnybar energi, avfallshantering, vattenrening och fastighets-effektiviseringar.

Under 2020 har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av:

Ellevio – investeringar för att förstärka elnäten och att minimera förlusten av energi. Dessutom installationer av smarta elmätare

som optimerar energianvändningen på hushållsnivå för att minska energianvändning.

Tornator – ett finländskt skogsbolag där investeringarna går till att bedriva ett hållbart skogsbruk samt för naturskyddsåtgärder.

Svenska staten gröna obligation – svenska statens första gröna obligation som bland annat syftar till att begränsa begränsa klimatförändringar, öka den biologiska mångfalden, främja projekt för förnybar energi eller sänka koldioxidutsläppen inom transportsektorn

Nordiska investeringsbankens blåa obligation – där investeringarna går till skydd och bevarande av vattenmiljöer i Östersjö-regionen.

Fondens hållbarhetsnivå är 9/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

Klusterbomber, personminor

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

Kärnvapen

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

Vapen och/eller krigsmaterial

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Alkohol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Tobak

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

Kommersiell spelverksamhet

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Pornografi

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi och cannabis.

Fonden exkluderar hela energisektorn (sektor 10: utvinning kol, olja, gas) och bolag vars omsättning till mer än 50 procent kommer från produktion och/eller distribution av fossila bränslen i övriga sektorer samt bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har exkluderat ett nytt bolag med anledning av fondens exkluderingskriterier.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en räntefond och investerar i räntebärande värdepapper som exempelvis statsobligationer, bostadsobligationer och företagscertifikat. Räntefonder har inget aktieinnehav vilket innebär att fondbolaget inte kan rösta på bolagsstämor, men i övrigt kan fondbolaget påverka i hållbarhetsfrågor.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 44 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden.

SPP FRN Företagsobligationsfond

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**
Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**
Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål..

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Företagsobligationsfond är en aktivt förvaltd räntefond och väljer in bolag som rankas högt i vår hållbarhetsanalys. Varje investering ska en hög kreditrating, Investment Grade med rating BBB- eller högre.

Under 2020 har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av Stora Enso, Faberge, Balder.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**
Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Kärnvapen**
Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.
- Vapen och/eller krigsmaterial**
Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Alkohol**
Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Tobak**
Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.
- Kommersiell spelverksamhet**
Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.
- Pornografi**
Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.
- Fossila bränslen (olja, kol, gas)**
Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.



Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.



Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi och cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Under 2020 har exkluderat ett nytt bolag med anledning av fondens exkluderingskriterier.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en räntefond och investerar i räntebärande värdepapper som exempelvis statsobligationer, bostadsobligationer och företagscertifikat. Räntefonder har inget aktieinnehav vilket innebär att fondbolaget inte kan rösta på bolagsstämor, men i övrigt kan fondbolaget påverka i hållbarhetsfrågor.

- Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 44 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden.

SPP Global Företagsobligation Plus

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fondbolagets kommentar:

- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**
Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål..

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP Global Företagsobligation Plus är en aktivt förvaltd räntefond och väljer in bolag som rankas högt i vår hållbarhetsanalys. Varje investering ska en hög kreditrating, Investment Grade med rating BBB- eller högre.

Fondens koldioxidavtryck är 3,14 och fondens jämförelseindex har 7,86*. Fonden har 10,9 procent högre hållbarhet än sitt jämförelseindex.

Fondens hållbarhetsnivå är 6/10.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

- Fonden väljer bort**

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

- Klusterbomber, personminor**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Kärnvapen**

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

- Vapen och/eller krigsmaterial**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Alkohol**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Tobak**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

- Kommersiell spelverksamhet**

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Pornografi**

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

- Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

- Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljökada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi och cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 79 av det underliggande indexets 498 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

- Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

- Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

- Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

- Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en räntefond och investerar i räntebärande värdepapper som exempelvis statsobligationer, bostadsobligationer och företagscertifikat. Räntefonder har inget aktieinnehav vilket innebär att fondbolaget inte kan rösta på bolagsstämningar, men i övrigt kan fondbolaget påverka i hållbarhetsfrågor.

- Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI).

Under 2020 har vi genomfört 29 dialoger med anledning av bolagens hållbarhetsarbete eller i bolagsstyrningsärenden

SPP High Yield Företagsobligation

Hållbarhetsinformation

- Hållbarhetsaspekter beaktas i förvaltningen av fonden
- Hållbarhetsaspekter beaktas inte i förvaltningen av fonden

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden

- Miljöaspekter** (t.ex. bolagens inverkan på miljö och klimat)
- Sociala aspekter** (t.ex. mänskliga rättigheter och lika-behandling)
- Bolagsstyrningsaspekter** (t.ex. aktieägarens rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption)
- Andra hållbarhetsaspekter**

Metoder som används för hållbarhetsarbetet

- Fonden väljer in**
- Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag.**

Fonden har specifika och uttalade kriterier för att välja in bolag utifrån miljö, sociala och affärsetiska frågor. Analys av bolagens arbete med hållbarhet är avgörande för valet av bolag i fonden.

Fondbolagets kommentar:
- Fondens förvaltare tar hänsyn till hållbarhetsfrågor**

Hållbarhetsaspekter beaktas i ekonomiska bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Fondbolagets kommentar: Alla bolag som väljs in i fonden får ett hållbarhetsbetyg där vi betygsätter bolagen utifrån många olika hållbarhetsindikatorer. Bolag som premieras i urvalet är ekonomiskt starka, har omfattande system för hantering av ESG-risker och bidrar positivt till FNs hållbarhetsmål.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer in

Vårt främsta verktyg för att välja in bolag är vår egen hållbarhetsanalys där vi ger varje bolag ett individuellt hållbarhetsbetyg. Vi genomför vår analys på cirka 4 500 bolag. Alla bolagen får ett betyg mellan 0-100.

SPP High Yield Företagsobligation är en hållbar aktivt förvaltat fond som investerar i företagsobligationer med låg kreditvärdighet, High Yield, i Norden med tyngdpunkt på Sverige. Fonden kommer i huvudsak att investera i företagsobligationer utställda av nordiska emittenter och har möjlighet att ta positioner som

<BBB, split-rating, BB/BBB, BBB med risk för nedgradering till BB eller de som saknar officiell rating

Under 2020 har vi bland annat valt in gröna obligationer emitterade av K2A Fastigheter, Cibus och Klöver.

Fondens koldioxidavtryck är 2,79 och fondens jämförelseindex har 9,71*.

* se sid 5 för mer information om koldioxidavtryck och hur det beräknas.

Fonden väljer bort

Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster. Högst fem procent av omsättningen i det bolag där placeringen sker får avse verksamhet som är hänförlig till den angivna produkten eller tjänsten..

Produkter och tjänster

Klusterbomber, personminor

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

Kärnvapen

Fondbolagets kommentar: Nolltolerans.

Vapen och/eller krigsmaterial

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Alkohol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Tobak

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av tobak.

Kommersiell spelverksamhet

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Pornografi

Fondbolagets kommentar: 0 % avseende produktion och max 5 % av intäkterna från distribution av pornografi.

Fossila bränslen (olja, kol, gas)

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Kol

Fondbolagets kommentar: Max 5 % produktion och/eller distribution.

Övrigt:

Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar även bolag vars omsättningen övertiger 5 % från produktion och/eller distribution av oljesand eller icke-medicinsk cannabis. Därutöver exkluderas ohållbar palmolja och bolag med stora fossilreserver, det vill säga bolag med mer än 100 miljoner ton CO₂ i fossila reserver.

Fondbolagets uppföljning av året – Väljer bort

Fonden väljer bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. Det omfattar mänskliga rättigheter, arbetsrätt och folkrätt, korruption och ekonomisk kriminalitet, allvarlig klimat- och miljöskada inklusive ohållbar palmolja och kontroversiella vapen. Vi exkluderar även bolag vars omsättning till mer än 5 procent kommer från produktion och/eller distribution av vapen- och krigsmateriel, tobak, alkohol, spel, pornografi och cannabis, fossila bränslen (kol, olja, gas) och bolag med stora fossilreserver.

Vid årsskiftet 2020 var 4 av det underliggande indexets 62 bolag exkluderade.

Vi har daglig uppföljning på samtliga innehav av en oberoende riskkontrollfunktion. Därutöver screenar vi investeringsuniverset fyra gånger per år.

Vi publicerar våra exkluderingslistor kvartalsvis på sppfonder.se/rapporter

Internationella normer

Fonden undviker att investera i bolag som är involverade i kränkningar av internationella normer och konventioner (åtminstone FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag) kring miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden undviker att investera i samtliga identifierade bolag som inte följer internationella normer.

Fondbolagets kommentar: Om vi misstänker överträdelse mot vår policy samlar vi in mer info och vi kan placera bolaget på observationslista. Vi har en nära dialog med bolagen om förväntningar. Beroende på resultat kan antingen exkludera bolaget eller så kan det åter vara investeringsbart

Bolag där fonden inte ser förändringsvilja eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta problemen under en acceptabel tidshorisont underkänns för investering.

Fondbolagets kommentar:

Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Fondbolagets kommentar:

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt ägarinflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Fonden är en räntefond och investerar i räntebärande värdepapper som exempelvis statsobligationer, bostadsobligationer och företagscertifikat. Räntefonder har inget aktieinnehav vilket innebär att fondbolaget inte kan rösta på bolagsstämningar, men i övrigt kan fondbolaget påverka i hållbarhetsfrågor.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Våra specialister inom hållbara investeringar och ägarstyrning & våra förvaltare har löpande dialog/möte med bolagen. Genom att aktivt ställa frågor ambitioner och aktiviteter inom området miljö & hållbarhet påverkar vi bolagen att leverera konkreta resultat och bidra till FNs hållbarhetsmål.

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Vid gemensamma frågor går vi samman med andra stora ägare genom vårt engagemang i UN PRI (FNs principer för ansvarsfulla investeringar) för att få större påverkanskraft.

Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter

Fondbolagets kommentar: Genom samarbete med Sustainalytics och ISS.

Fondbolagets uppföljning av året – Påverkar

Ett aktivt ägande minskar riskerna och förbättrar kvaliteten i våra investeringar. Genom dialog och aktivt ägarskap försöker vi påverka bolag att följa och respektera internationella normer och konventioner samt bedriva sin verksamhet på ett hållbart sätt. Vi gör det såväl på egen hand som genom samarbete med andra investerare. Många dialoger sker i samarbete med FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar (PRI). Fonden startades under sommaren 2020 och vi har inte haft några dialoger kopplade till fonden under året.

SPP Fonder AB

SPP Fonder AB är ett helägt dotterbolag till Storebrand Asset Management AS, som i sin tur ägs av Storebrand ASA. Tillsammans med SPP Pension & Försäkring är vi en av Nordens ledande koncerner för sparande och försäkringslösningar.

Syftet med denna uppföljning av vårt hållbarhetsarbete per fond är att ge en allmän information och kan alltså inte ensamt utgöra underlag för investeringsbeslut. Vi anser att de källor och bearbetningsmetoder som vi använt oss av vid utarbetandet av analyser är tillförlitliga. Vi påtar oss inget ansvar för riktigheten eller fullständigheten i prognoser eller analyser eller för eventuella brister i källmaterialet. SPP Fonder svarar inte för förlusten som kan tänkas uppkomma genom att någon följer vad som sagt i denna publikation eller använder sig av häri lämnade uppgifter.

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida utveckling. De pengar som placeras i fonder kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta beloppet. En fond med riskklass 6-7 kan på grund av sin sammansättning och fondbolagets förvaltningsmetoder minska och öka kraftigt i värde. På sppfonder.se hittar du faktablad och informationsbroschyrer. Alla våra fonder förvaltas enligt en hållbarhetsstrategi som bygger på metoderna **Välja in, Välja bort** och **Påverka**, för mer information se sppfonder.se/hallbarhet.

Välkommen till sppfonder.se eller ring 08-614 24 50.

SPP Fonder AB. SE-105 39 Stockholm .

Org.nr. 556397-8922. Styrelsens säte: Stockholm.

 spp fonder

En del av Storebrand