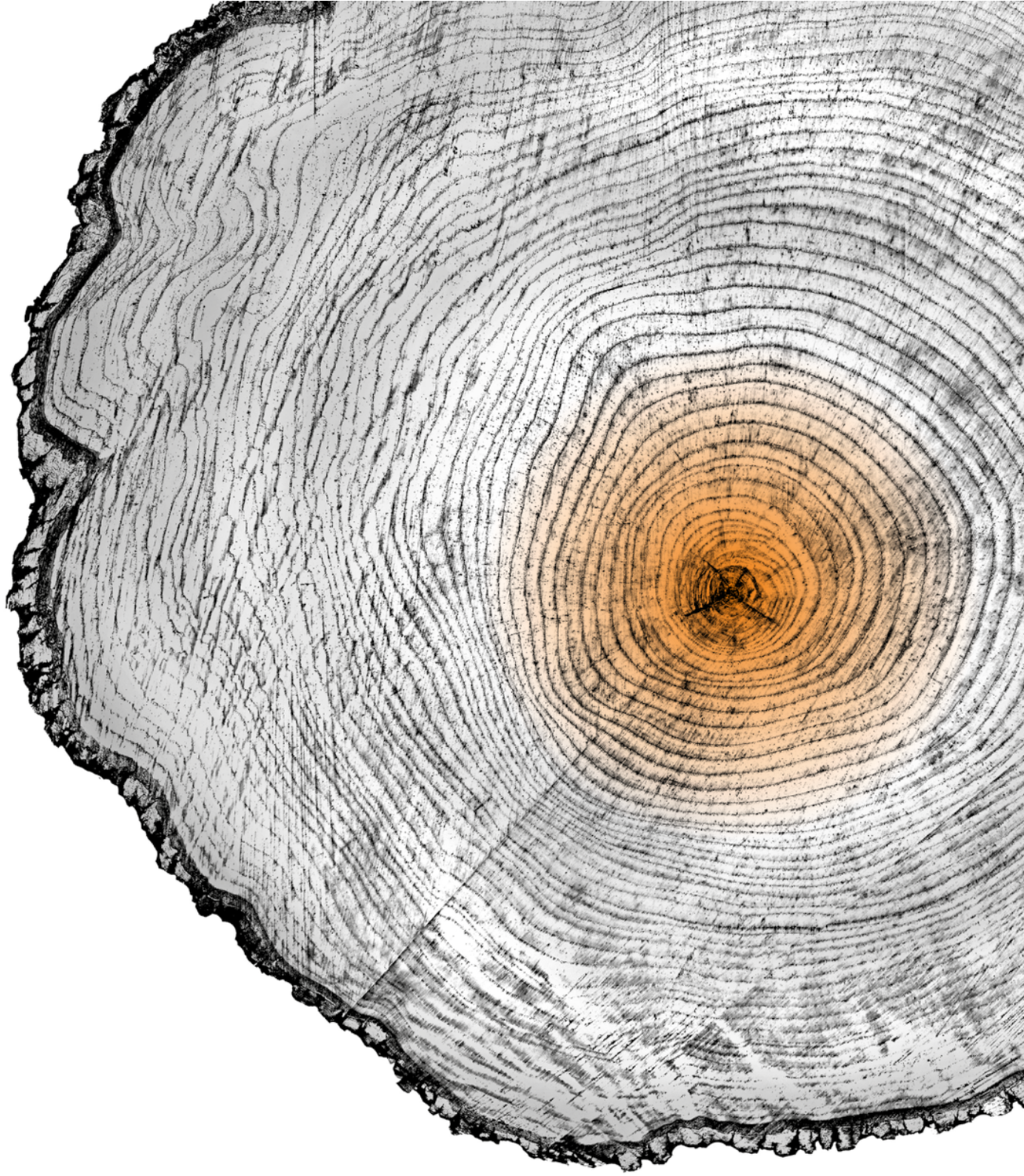
Hållbarhets-sammanställning 2017



movestic
Liv&Pension

Hållbarhets-sammanställning 2017

Hållbarhetssammanställningen har som mål att vara ett komplement till den hållbarhetsinformation som uppdateras löpande på Movestic.se:

- Morningstars hållbarhetsbetyg
- Om fonden har deklarerat sitt arbete i Swesifs Hållbarhetsprofil

Den kompletterande information som finns med i hållbarhetssammanställningen är:

- Om fondbolaget signerat och följer PRIs principer
- Information om fonderna i Movestics utbud utesluter specifika typer av investeringar
- Movestics eget hållbarhetsbetyg (samt i vissa fall kompletterande information till de betyg som givits)

Nedan följer en förklaring av de olika delarna i sammanställningen.

Movestics hållbarhetsbetyg
Movestic genomför varje år en omfattande enkätundersökning där fondbolagen ombeds svara på frågor om sitt hållbarhetsarbete. För att ge en mer rättvisande bild av fondens hållbarhetsarbete i förhållande till dess förutsättningar delas fonderna in i fyra kategorier; aktiva aktiefonder, passiva aktiefonder, räntefonder samt hedgefonder.

Frågornas svar analyseras och sätts samman till ett helhetsbetyg där rött avser icke godkänt, gult godkänt och grönt väl godkänt/best practice inom kategorin. Betyget är framförallt en helhetsbedömning av hur integrerat hållbarhetsarbete är i fondens dagliga förvaltning. I vissa fall förklaras betygen ytterligare i medföljande kommentarer. För att ett bolag ska uppnå grönt betyg ska fondbolaget som minimum ha signerat UNPRI, utesluta investeringar i kontroversiella vapen och kärnvapen samt ha ett strukturerat förhållningssätt till identifiering och hantering av investeringar i bolag som på något sätt kränker internationella normer. Fondbolaget ska även arbeta med och redovisa sitt påverkansarbete samt strukturerat rösta för sina innehav. Movestics egna fonder omfattas inte av Movestics hållbarhetsbetyg (eftersom vi inte betygsätter vårt eget hållbarhetsarbete). Övrig information finns dock redovisad i översikten.

Morningstar Sustainability Rating
Morningstar Sustainability Rating strävar mot att ge en sammanfattande bild av hur hållbara en fonds innehav är i förhållande till andra fonders innehav inom samma fondkategori. Korta positioner, optioner och derivat täcks inte av analyserna och därför saknar de flesta hedgefonder rating. Högsta betyg är fem av fem jordglober.

Ett villkor för att sätta hållbarhetsbetyg på en fond är att mer än 50 procent av fondens senast rapporterade innehav täcks av analysföretaget Sustainalytics utvärderingar. Sustainalytics täcker

UNPRI

Principles for Responsible Investment, PRI, är FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar.

främst stora börsbolag vilket gör att flera fonder med investeringar i småbolag saknar rating. Morningstars beräkning tar inte hänsyn till eller belönar negativa urval och ger heller någon indikation på om förvaltaren har lyckats med positiv påverkan på företagsledningen. Mer om Morningstars hållbarhetsbetyg på Morningstar.se

UNPRI
Principles for Responsible Investment, PRI, är FNs initiativ för ansvarsfulla investeringar. PRIs syfte är att driva på utvecklingen inom hållbarhet genom att skapa ramverk för hur hållbarhet kan integreras i den dagliga förvaltningen.

Genom att signera PRI förbinder sig fondbolagen att följa sex principer för ansvarsfulla investeringar. Mer om dessa principer finns att läsa på https://www.unpri.org/

Swesif hållbarhetsprofil
Hållbarhetsprofilen, som skapats på initiativ av Swesif, ger en sammanfattande bild av hur fonder arbetar med ansvarsfullt ägande utifrån de tre grundprinciperna; Välja in, Välja bort och Påverka. Hållbarhetsprofilen är en självdeklaration som fondbolagen gör för sina fonder. Målsättningen är att denna ska vara en hjälp till investerare för att få en övergripande bild över hur fonden hanterar hållbarhetsfrågor.

Uteslutningar
I sammanställningen visas om fonden utesluter investeringar som är involverade i kontroversiella vapen (som klusterbomber och personminor), kärnvapen samt fossila bränslen. Tabellen visar även eventuella etiska uteslutningar.

Kriterierna för uteslutningar kan skilja sig åt mellan fondförvaltare där vissa tillämpar nolltolerans medan andra exempelvis tillåter att upp till fem procent av omsättningen härrör från den sektor som avses. För de fonder som har deklarerat sitt arbete i Hållbarhetsprofilen framgår vilken nivå av bolagets omsättning som accepteras från den angivna produkten/sektorn.

Särskilt Hållbarhetsfokus
Vissa fonder har ett särskilt hållbarhetsfokus i sitt mandat. Detta kan typiskt vara nischfonder som adresserar specifika hållbarhetsproblem – exempelvis klimatförändring eller fonder som arbetar med så kallade positiva urval, med andra ord premierar bolag som arbetar aktivt med hållbarhetsfrågor. Fonder med särskilt hållbarhetsfokus kan även omfatta fonder som utesluter specifika sektorer som för investerare kan anses som kontroversiella.

Swesif

Swesif är ett oberoende, icke-vinstdrivande forum för organisationer som arbetar med hållbara investeringar i Sverige. Verksamheten syftar till att öka kunskapen och intresset för hållbara och ansvarsfulla investeringar (SRI) både i och utanför branschen.

Aktiva aktiefonder



	HÅLLBARHETSBETYG & SAMARBETEN				FONDEN UTESLUTER*				ÖVRIGT
Aktiva aktiefonder	**Movestics hållbarhets-betyg**	**Morningstar Sustainability Rating**	**UNPRI**	**Swesif Hållbarhets-profil**	**Kontro-versiella vapen**	**Kärnvapen**	**Fossila bränslen**	**Etiska uteslutningar**	**Särskilt hållbarhets-fokus**
AGCM ASIA GROWTH FUND	●	2	✘	◔	✔	✔	✔	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✘
AKTIE ANSVAR SVERIGE	●	1	✘	◔	✔	✔	✘	Vapen, Tobak, Pornografi, Spel	✘
CARNEGIE RYSSLANDSFOND	●	3	✔	◔	✔	✔	✘	–	✘
DIDNER & GERGE SMÅBOLAG	●	1	✔	◔	✔	✔	✘	Pornografi, Spel	✘
DIDNER & GERGE SMALL & MICRO CAP.	●	N/A	✔	◔	✔	✔	✘	Pornografi, Spel	✘
DIDNER & GERGE GLOBAL	●	2	✔	◔	✔	✔	✘	Pornografi, Spel	✘
DIDNER & GERGE AKTIEFOND	●	5	✔	◔	✔	✔	✘	Pornografi, Spel	✘
DNB TELECOM	●	3	✔	◔	✔	✔	✘	Tobak, Pornografi	✘
DNB TEKNOLOGI	●	4	✔	◔	✔	✔	✘	Tobak, Pornografi	✘
DNB FINANS	●	3	✔	◔	✔	✔	✘	Tobak, Pornografi	✘
EVLI SVERIGE SMÅBOLAG**	●	N/A	✔		✘	✘	✘	–	✘
FIDELITY PACIFIC	●	N/A	✔		✘	✘	✘	–	✘
HANDELSBANKEN LATINAMERIKAFOND	●	4	✔	◔	✔	✔	✘	–	✘
MAQUARIE ASIA NEW STARS	●	N/A	✔	◔	✔	✔	✘	Tobak	✘
MOVESTIC BIOTEKNIK	N/A	4	✔	◔	✔	✔	✔	Vapen, Alkohol, Tobak, Spel, Pornografi, Kol	✘
MOVESTIC EUROPA	N/A	5	✔	◔	✔	✔	✘	–	✘
MOVESTIC EUROPA SMÅBOLAG	N/A	4	✔	◔	✔	✔	✘	–	✘
MOVESTIC FASTIGHETER	N/A	N/A	✔	◔	✔	✔	✘	–	✘
MOVESTIC GLOBAL	N/A	4	✔	◔	✔	✔	✘	–	✘
MOVESTIC GLOBALA TILLVÄXTMARKNADER	N/A	N/A	✔	◔	✔	✔	✘	–	✘
MOVESTIC HEALTHCARE	N/A	2	✔	◔	✔	✔	✔	Vapen, Alkohol, Tobak, Spel, Pornografi, Kol	✘

** Det exakta mandatet för uteslutningar kan skilja sig åt mellan olika fonder.*
*** Enligt Evlis formella mandat så utesluts inga sektorer, i praktiken så finns inga investeringar i bolag med verksamhet relaterat till kontroversiella vapen eller kärnvapen och enligt Evli så finns inte några sådana planer.*

	HÅLLBARHETSBETYG & SAMARBETEN				FONDEN UTESLUTER*				ÖVRIGT
Aktiva aktiefonder	**Movestics hållbarhets-betyg**	**Morningstar Sustainability Rating**	**UNPRI**	**Swesif Hållbarhets-profil**	**Kontro-versiella vapen**	**Kärnvapen**	**Fossila bränslen**	**Etiska uteslutningar**	**Särskilt hållbar-hetsfokus**
MOVESTIC SVERIGE	N/A	4	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
MOVESTIC SVERIGE SMÅBOLAG	N/A	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
OPM LISTED PRIVATE EQUITY	●	N/A	✔	✔	✘	✘	✘	–	✘
ODIN EMERGING MARKETS	●	5	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
PARVEST EQUITY BEST SELECTION EURO	●	2	✔		✔	✔	✘	–	✘
PARVEST EQUITY BRAZIL	●	3	✔		✔	✔	✘	–	✘
PARVEST EQUITY WORLD ENERGY	●	2	✔		✔	✔	✘	–	✘
PARVEST EQUITY NORDIC SMALL CAP	●	N/A	✔		✔	✔	✘	–	✘
PARVEST EQUITY WORLD CONSUMER DURABLES	●	2	✔		✔	✔	✘	–	✘
SIMPLICITY AFRIKA	●	5	✘	✔	✔	✔	✘	–	✘
SEB ÖSTEUROPAFOND EX RYSSLAND	●	2	✔	✔	✔	✔	✔	–	✘
SCHRODER GLOBAL CLIMATE CHANGE	●	3	✔	✔	✔	✔	✔	–	✔
SCHRODER JAPANESE SMALLER COMPANIES	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
SCHRODER MIDDLE EAST	●	3	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
SCHRODER US SMALL & MID-CAP EQUITY	●	3	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
SCHRODER EMERGING EUROPE	●	3	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
FRANKLIN INDIA	●	3	✔		✔	✘	✘	–	✘
FRANKLIN GLOBAL SMALL-MID CAP GROWTH	●	4	✔		✔	✘	✘	–	✘
FRANKLIN GOLD AND PRECIOUS METALS	●	2	✔		✔	✘	✘	–	✘
TUNDRA PAKISTAN	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
TUNDRA SUSTAINABLE FRONTIER	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✔	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
ÖHMAN GLOBAL HÅLLBAR	●	5	✔	✔	✔	✔	✔	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔

** Det exakta mandatet för uteslutningar kan skilja sig åt mellan olika fonder.*

Passiva aktiefonder



	HÅLLBARHETSBETYG & SAMARBETEN				FONDEN UTESLUTER*				ÖVRIGT
Passiva aktiefonder**	**Movestics hållbarhets-betyg**	**Morningstar Sustainability Rating**	**UNPRI**	**Swesif Hållbarhets-profil**	**Kontro-versiella vapen**	**Kärnvapen**	**Fossila bränslen**	**Etiska uteslutningar**	**Särskilt hållbar-hetsfokus**
BLACKROCK JAPAN EQUITY INDEX FUND	●	3	✔		✘	✘	✘	–	✘
BLACKROCK EMERGING MARKETS EQUITY INDEX FUND	●	2	✔		✘	✘	✘	–	✘
BLACKROCK PACIFIC EX JAPAN EQUITY INDEX FUND	●	4	✔		✘	✘	✘	–	✘
SEB EUROPA INDEXFOND	●	3	✔	◔	✔	✔	✔	–	✘
ÖHMAN ETISK EMERGING MARKETS	●	2	✔	◔	✔	✔	✘	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
ÖHMAN ETISK INDEX EUROPA	●	3	✔	◔	✔	✔	✘	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
ÖHMAN ETISK INDEX JAPAN	●	3	✔	◔	✔	✔	✘	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
ÖHMAN ETISK INDEX PACIFIC	●	5	✔	◔	✔	✔	✘	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
ÖHMAN ETISK INDEX SVERIGE	●	3	✔	◔	✔	✔	✘	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
ÖHMAN ETISK INDEX USA	●	3	✔	◔	✔	✔	✘	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔

** Det exakta mandatet för uteslutningar kan skilja sig åt mellan olika fonder.*
*** Passiva fonder följer generellt ett bestämt index och investerar därmed i alla aktier som finns representerade i ett index utan att ta hänsyn till företagens verksamhet. Därmed har indexfonder generellt sett inte en hållbarhetsprofil såvida fonden inte gör specifika uteslutningar enligt sina fondmandat.*

Räntefonder



	HÅLLBARHETSBETYG & SAMARBETEN				FONDEN UTESLUTER*				ÖVRIGT
Räntefonder	**Movestics hållbarhets-betyg**	**Morningstar Sustainability Rating**	**UNPRI**	**Swesif Hållbarhets-profil**	**Kontro-versiella vapen**	**Kärnvapen**	**Fossila bränslen**	**Etiska uteslutningar**	**Särskilt hållbar-hetsfokus**
AKTIE ANSVAR AVKASTNINGSFOND	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	Vapen, Tobak, Pornografi, Spel	✘
ALFRED BERG OBLIGATIONSFOND PLUS HÅLLBAR	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✔	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
ALFRED BERG PENNINGMARKNADSFOND HÅLLBAR	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✔	Vapen, Alkohol, Tobak, Pornografi, Spel	✔
JP MORGAN INCOME OPP PLUS	●	N/A	✔		✘	✘	✘	–	✘
EVLI HIGH YIELD**	●	N/A	✔		✘	✘	✘	Vapen, Tobak	✘
MOVESTIC KORTA RÄNTOR PLUS	N/A	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	–	✘
MUZINICH AMERICAYIELD	●	N/A	✔		✔	✘	✘	–	✘
TEMPLETON EMERGING MARKETS BOND	●	N/A	✔		✔	✘	✘	–	✘
TEMPLETON GLOBAL BOND	●	N/A	✔		✔	✘	✘	–	✘
ÖHMAN FIXED INCOME ALLOCATION FUND	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	Pornografi	✘
ÖHMAN REALRÄNTEFOND	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	Pornografi, Alkohol, Tobak, Spel	✘
ÖHMAN FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND	●	N/A	✔	✔	✔	✔	✘	Pornografi, Alkohol, Tobak, Spel	✘

** Det exakta mandatet för uteslutningar kan skilja sig åt mellan olika fonder.*
*** Enligt Evlis formella mandat så utesluts inga sektorer, i praktiken så finns inga investeringar i bolag med verksamhet relaterat till kontroversiella vapen eller kärnvapen och enligt Evli så finns inte några sådana planer.*

Hedgefonder



	HÅLLBARHETSBETYG & SAMARBETEN				FONDEN UTESLUTER*				ÖVRIGT
Räntefonder	**Movestics hållbarhets-betyg**	**Morningstar Sustainability Rating**	**UNPRI**	**Swesif Hållbarhets-profil**	**Kontro-versiella vapen**	**Kärnvapen**	**Fossila bränslen**	**Etiska uteslutningar**	**Särskilt hållbar-hetsfokus**
ATLANT SHARP**	●	N/A	✘		✔	✔	✔	Alkohol, Tobak, Pornografi, Vapen	✘
AKTIE ANSVAR GRAAL	●		✔		✔	✔	✘	Alkohol, Tobak, Pornografi, Vapen, Spel	✘
AKTIE ANSVAR GRAAL OFFENSIV	●	N/A	✔		✔	✔	✘	Alkohol, Tobak, Pornografi, Vapen, Spel	✘
LYNX DYNAMIC***	N/A	N/A	✔		✘	✘	✘	–	✘
PRIORNILSSON YIELD	●	N/A	✘		✔	✔	✘	Vapen	✘
SEB ASSET SELECTION***	N/A	N/A	✔		✘	✘	✘	*Utesluter index med över 20 procent av omsättningen kopplad till kärnvapen	✘

** Det exakta mandatet för uteslutningar kan skilja sig åt mellan olika fonder.*
*** Angivna exkluderingar avser räntedelen av portföljen.*
**** För fonderna Lynx Dynamic och SEB Asset Selection redovisas inte Movestics hållbarhetsbetyg. Fonderna är modellbaserade hedgefonder som investerar i aktieindex, räntor, valutor och råvaror på de globala terminsbörserna, detta innebär att de har svårt att efterleva traditionella metoder för hållbara investeringar.*

www.movestic.se

movestic
Liv&Pension