

# Hållbarhetsnivån i SPPs fondutbud

**Storebrandkoncernen, där SPP ingår, har arbetat med hållbara investeringar ända sedan 1995 och redan då användes hållbarhetsdata som en del i investeringsbeslutet.**

Sedan dess har både tillgången på data och vår metod utvecklats och förfinats, men grundtanken är densamma: Det är vår övertygelse att långsiktig avkastning bygger på att det finns en hållbarhet i bolagens verksamheter. Vi vill erbjuda våra kunder en hög lägstanivå och stor transparens i hur våra investeringar görs för att undvika negativ hållbarhetsrisk och för att vikta upp bolag som bidrar positivt till att vi når våra hållbarhetsmål.

Vi räknar ut en hållbarhetscore för omkring 4,500 bolag baserat på bolagens ESG\*-praxis och bolagens positionering gentemot finansiellt relevanta mål inom FN:s Agenda 2030\*, som innefattar de 17 globala hållbarhetsmålen. Bolagen får ett betyg mellan 0 och 100, enligt metoden som visas i bilden nedan.

Vi använder hållbarhetsratingen i kombination med annan kvalitativ information för att ge portföljförvaltare en bättre förståelse för företagens hållbarhetsrisk- och möjligheter. Betyget används för att optimera portföljer mot bättre företag och för att beräkna vår egen fondnivå som också beskrivs nedan, som gör det lättare för våra kunder att hitta de mest hållbara fonderna.

\*ESG= Environmental, social och governance (ägarstyrning); Agenda 2030 innehåller FN:s 17 globala mål för hållbar utveckling som brukar förkortas SDG (sustainable development goals)



Utvärderar fondens exponering mot ESG-risk

Målet är att minska portföljens exponering mot negativ ESG-risk

Mäter möjligheter relaterade till FN:s hållbarhetsmål (SDG:erna) och Parisavtalet, fokuserat på bolag med produkter och tjänster som bidrar till att uppfylla hållbarhetsmålen. 10% av ratingen baseras på jämställdhetsdata

Målet är att öka portföljens exponering mot lösningsbolag och jämställda bolag

Sammanvägningen av ESG-riskbetyget och SDG-möjlighetsbetyget

Fondförvaltarna optimerar investeringarna för att välja in bolag med så höga hållbarhetsratingar som möjligt

Det viktade genomsnittet av portföljbolagens hållbarhetsrating omvandlat till skalan 0-10

10 är de mest hållbara bolagen som är anpassade för framtidens utmaningar och samtidigt har låga hållbarhetsrisker

- Hållbarhetsratingen är ett verktyg för att erbjuda ett mer hållbart sparande. Fondens hållbarhetsnivå ger kunderna information om hur hållbara bolagen i fonden är och ska hjälpa kunderna att kunna välja ett hållbart sparande
- Hållbarhetsratingen är absolut och kan därför jämföras på region-, sektor-, bransch- och innehavsnivå
- Hållbarhetsnivån i fonden återspeglar den underliggande hållbarhetsratingen. Den påverkas inte av den individuella portföljförvaltarens inställning eller åsikt
- Koncernens portföljförvaltare har tillgång till hållbarhetsdata på flera nivåer: Total Score, ESG Risk Score, SDG Score och underliggande rådata.
- Data samlas in via externa leverantörer och öppna källor. Vi använder både dataleverantörernas analyser och egna kvalitativa analyser
- Minst hälften av fondens portfölj, uppmätt i marknadsvärde, måste ha en hållbarhetsrating för att fonden ska märkas med hållbarhetsnivån
- De flesta av våra aktivt förvaltade fonder och indexnära fonder har en bättre hållbarhetsnivå än deras referensindex
- Företagens hållbarhetsrating är en av många faktorer som aktivt integreras i förvaltningen av våra fonder
- I Sparande med garanti används förutom hållbarhetsratingen av bolagen i vårt investeringsunivers även en rating av fastighetsbeståndet. Den baseras på den årliga, globala utvärderingen GRESB, Global Real Estate Sustainability Benchmark
- GRESB-data används av hundratals investerare och tusentals kapitalförvaltare för att jämföra investeringar och portföljer samt förstå de möjligheter och risker kopplade till investeringarna. SPP använder den ranking, på en skala 0-100, som SPP Fastigheter får, och viktar in den med hållbarhetsratingen

