

Mall som avser upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Hållbar investering:

en investering i ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något annat miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU-taxonomin är ett klassificeringssystem som läggs fram i förordning (EU) 2020/852, där det fastställs en förteckning över **miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter**.

Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.



Produktnamn: *Sensum Strategy Global*

Identifieringskod för juridiska personer: 515603-2434

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

Ja

Nej

Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett miljömål**: ___%

i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

Den kommer att göra ett minimum av **hållbara investeringar med ett socialt mål**: ___%

Den **främjar miljörelaterade och sociala egenskaper** och kommer, även om den inte har en hållbar investering som sitt mål, att ha en minimiandel på ___% hållbara investeringar

med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomin

med ett socialt mål

Den **främjar miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **kommer inte att göra några hållbara investeringar**

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt? *Fonden främjar hållbarhet i investeringsprocessen. Detta innebär att produkten främjar miljörelaterade, sociala egenskaper och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning. Förvaltaren är övertygad om att värdeskapande över tid förutsätter ett hållbart synsätt. Förvaltaren letar därför endast efter ansvarsfulla välskötta bolag med långsiktigt lönsamma och hållbara affärsmodeller. På så sätt främjas hållbarhetsrelaterade egenskaper i fonden. Genom att införliva miljö, samhällsansvar och bolagsstyrningsfrågor i investeringsbesluten kommer fonden Sensum Strategy Global (Sensum) förhoppningsvis att bidra till ett mer ansvarsfullt och hållbart företagande. Att ta hänsyn till frågor som rör miljö och socialt ansvarstagande och beakta negativa konsekvenser för hållbar utveckling är en integrerad del i investeringsprocessen. Detta sker genom en grundlig analys av samtliga bolag innan en investering sker, där bland annat frågor om bolagens strategi, finansiella och icke-finansiella resultat och risker, kapitalstruktur, social- och*

miljömässig påverkan och bolagsstyrning beaktas.

Fondens investeringar främjar exempelvis uppfyllandet av globalt uppsatta åtaganden och mål såsom Parisavtalet och FN:s Agenda 2030. Fonden främjar även högre standarder och praxis av generell prestation inom E, S och G hos bolagen.

Inget specifikt index anges som referensindex i syfte att uppnå miljömässiga eller sociala egenskaper som främjas av fonden.

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

- **Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?** De hållbarhetsindikatorer som används för att mäta uppnåendet av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av fonden är:

1. GHG-utsläpp Scope 1,2,3
2. Totala GHG-utsläpp
3. Koldioxidavtryck
4. Investeringsobjektens GHG-intensitet
5. Andel investeringar i företag verksamma i sektorn för fossila bränslen
6. Investeringsobjektens andel förbrukning av icke-förnybar energi och icke-förnybar energiproduktion från icke förnybara energikällor
7. Investeringsobjektens energiförbrukning i Gwh per miljon euro i omsättning, per sektor med hög klimatpåverkan
8. Andel investeringar i företag med verksamhet belägen i eller nära områden med känslig biologisk mångfald
9. Ton utsläpp i vatten från investeringsobjekten per investerad miljon (euro), uttryckt som ett viktat genomsnitt
10. Ton farligt avfall från investeringsobjekten per investerad miljon (euro), uttryckt som ett viktat genomsnitt
11. Andel investeringar i företag som varit inblandade i brott mot principerna i FN:s Global Compact eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag
12. Genomsnittligt ojusterat lönegap
13. Genomsnittlig andel kvinnor/män i styrelsen
14. Andel investeringar involverade i tillverkning eller försäljning av kontroversiella vapen
15. Andel investeringar i företag som saknar policydokument för att övervaka efterlevnaden av Global Compact eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag eller mekanismer för att hantera klagomål i fråga om överträdelser av Global Compact eller OECD:s riktlinjer för multinationella företags kränkningar av FN:s Globala Kompakta principer (UNGC) och Organisationen för ekonomiskt samarbete och Utvecklingsriktlinjer (OECD) för multinationella företag.

De externa leverantörer som används för datainsamling och analys är: Datia, Sustainalytics Risk Score, MSCI Rating ESG, Bloomberg ESG. Vidare undersöks om bolagen i fråga rapporterar på Science Based Targets samt vilka relevanta hållbarhetsindex de är med i.

- **Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?**



Ej tillämplig då fonden inte har någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering? Ej tillämplig då fonden inte har någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats? Ej tillämplig då fonden inte har någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Ej tillämplig då fonden inte har någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

Huvudsakliga

negativa

konsekvenser är investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljö, sociala frågor och personalfrågor, respekt för mänskliga rättigheter samt frågor rörande bekämpning av korruption och mutor.



I EU-taxonomi fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att inte orsaka betydande skada är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.

Beaktas i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Ja, _____ ✘

Ja, fonden beaktar huvudsakliga negativa konsekvenser på hållbarhetsfaktorer ("PAI"). PAI på hållbarhetsfaktorer beaktas av förvaltaren med avseende på fonden, där förvaltaren försöker identifiera PAI som en del av investeringsprocessen, både under bedömningarna före investeringar men också som en del av dess löpande uppföljning av investeringar. Detta innebär att förvaltaren utför sin egen analys av fondens portfölj mot relevanta PAI-indikatorer och/eller i kontakt med externa dataleverantörer som försöker ackumulera data som är tillgänglig för de företag som investerats i. Förvaltaren använder en kombination av metoder för att lindra PAI där välja in/välja bort är huvudregeln.

När förvaltaren beaktar PAI, som en del av den övergripande hållbarhetspolicyn, övervägs om alla obligatoriska PAI-indikatorer som beskrivs i bilaga I till kommissionens delegerade Förordning 2022/1288 (som kan ändras, uppdateras eller kompletteras från tid till annan) som är relevant för investeringsstrategin. De PAI-indikatorer som inte anses relevanta för investeringsstrategin eller där förvaltaren inte har tillgång till tillräckligt data för att utvärdera dessa PAI kommer inte att övervägas löpande. De PAI som följs upp av förvaltaren för närvarande är:

- *Utsläpp av växthusgaser*
- *Energiprestanda*
- *Biologi och vatten*
- *Sociala frågor och personalfrågor*

Nej

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Fonden har olika strategier för att uppnå specifika mål. I detta avsnitt beskrivs fondens investeringsstrategi för att uppfylla de miljö-, sociala- och bolagsstyrningsfaktorer som fonden främjar.

Förvaltaren är övertygad om att värdeskapande över tid förutsätter ett hållbart synsätt, och letar därför endast efter ansvarsfulla välskötta bolag med långsiktigt lönsamma och hållbara affärsmodeller. Genom att identifiera och investera i sådana bolag skapas långsiktigt värde för fondandelsägarna. Investeringar i hållbara bolag ökar möjligheterna till god avkastning, och därför är hållbarhetsanalysen en betydelsefull del av fondens investeringsprocess. Vid fondens bolagsval tar förvaltaren inte bara hänsyn till ekonomisk avkastning utan även till miljö-, sociala- och bolagsstyrningsfaktorer i investeringsprocessen. På så sätt främjas hållbarhetsrelaterade egenskaper i fonden. Genom att införliva miljö, samhällsansvar och bolagsstyrningsfrågor i investeringsbesluten bidrar Sensum förhoppningsvis till ett mer ansvarsfullt och hållbart företagande.

Att ta hänsyn till frågor som rör miljö och socialt ansvarstagande samt att beakta negativa konsekvenser för hållbar utveckling är en integrerad del i investeringsprocessen. Detta sker genom en grundlig analys av bolagen, där bland annat frågor om bolagens strategi, finansiella och icke-finansiella resultat och risker, kapitalstruktur, social- och miljömässig påverkan och bolagsstyrning beaktas, innan en investering sker. Vidare beaktas FN:s principer för ansvarsfulla investeringar, FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, internationella normer samt att ägarinflytande i förekommande fall kan användas för att främja miljön och/eller sociala egenskaper.

Sensum använder en välj in/välj bort investeringsstrategi. De bolag fonden investerar i förväntas ta ansvar för sin verksamhet och nå upp till de förväntningar som finns uppsatta i internationella ramverk samtidigt som fonden undviker att investera i bolag som inte lever upp till dessa kriterier. Rent praktiskt ser det ut som följer:

Välj in - Inkludering av investeringar i portföljen som förvaltaren tror främjar det miljömässiga och/eller sociala egenskaper. I strävan efter att identifiera företag som främjar de miljömässiga och/eller sociala egenskaper som beskrivs ovan, åtar sig

förvaltaren att identifiera och bedöma olika typer av affärsmässiga frågor som en del av bolagsurvalet. Detta inkluderar exempelvis analys av växthusgasutsläpp, minskningsinitiativ, klimatförändringsrelaterade risker och företagets beredskap generellt. Både innan och under en investerings livslängd använder förvaltaren en kvalitativ metod för att bedöma om främjandet av de sociala och/eller miljömässiga egenskaperna med regelbundenhet uppfylls. Detta görs genom att använda allmänt tillgänglig information som förvaltaren har identifierat som väsentlig för sådana bedömningar och uppföljningar. Exempel på sådan väsentlig allmänt tillgänglig information kan vara bokslutsrapporter, investerarevenemang och möten som anordnas av företaget, branschinformation och all annan sådan information, inklusive information som erhållits från engagemang med externa dataleverantörer/konsulter. Dessutom, som del av att bedöma och övervaka efterlevnaden av de hållbarhetsfrågorna, kan förvaltaren interagera med företagen.

Välj bort - Uteslutning av vissa investeringar från portföljen som strider mot uppsatta miljömässiga och/eller sociala egenskaper. 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 som omfattas:

Klusterbomber, personminor

Kemiska och biologiska vapen

Kärnvapen

Vapen och/eller krigsmateriel

Alkohol

Tobak

Pornografi

Fondens huvudregel är att inte investera i bolag som kränker internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. Bedömningen görs antingen av förvaltaren självt eller med hjälp av en eller flera underleverantörer. Inga nya investeringar görs i bolag som bryter mot internationella normer och konventioner. För befintliga innehav där det uppdagas att bolaget inte följer de principer för hållbarhet fonden har och ingen förändring väntas ske inom en acceptabel tidsperiod så kommer fonden att sälja innehavet.

Förvaltaren förbinder sig att endast investera i företag som denne bedömer följer god styrning och förvaltningspraxis såsom sunda ledningsstrukturer, anställningsförhållanden, ersättning till personal och efterlevnad av skatteregler. Vidare förbinder sig förvaltaren att utesluta företag från fondens portfölj som denne inte anser följer god förvaltningspraxis och styrning.

I syfte att investera i företag som följer god förvaltningspraxis och utesluta företag som inte följer god förvaltningspraxis identifierar, bedömer och övervakar förvaltaren flera bedömningskriterier som denne tror är viktiga för att bedöma om ett företag har god

styrning enligt dess uppfattning, inklusive men inte begränsat till, vad denne anser vara sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Förvaltaren övervakar regelbundet att ett bolag som fonden har investerat i upprätthåller praxis för god styrning genom att använda allmänt tillgänglig information som exempelvis bokslut och rapporter som lämnats av ett företag, investerarevenemang och möten som anordnas av ett företag, branschinformation och annan eventuellt annan information som förvaltaren har identifierat som väsentlig.

- **Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt? Hela investeringsprocessen som beskrivs ovan innehåller de bindande delarna av investeringsstrategin som används för att välja investeringar för att uppnå var och en av miljö- eller sociala egenskaper som främjas av fonden.**
- **Hur stor är minimiandelen för att minska omfattningen av de investeringar som beaktades innan investeringsstrategin tillämpades? Ej tillämplig då det ej har formulerats något sådant åtagande för fonden.**
- **Vad är policyn för att bedöma praxis för god styrning i investeringsobjekten? Förvaltaren förbinder sig att endast investera i företag som denne bedömer följer god styrning och förvaltningspraxis såsom sunda ledningsstrukturer, anställningsförhållanden, ersättning till personal och efterlevnad av skatteregler. Vidare förbinder sig förvaltaren att utesluta företag från fondens portfölj som denne inte anser följer god förvaltningspraxis. Fonden kommer vidare inte att placera i företag med bristande efterlevnad av internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag.**

I syfte att investera i företag som följer god förvaltningssed och utesluta företag som inte följer god förvaltningssed identifierar, bedömer och övervakar förvaltaren flera bedömningskriterier som denne tror är viktiga för att bedöma om ett företag har god styrning enligt dess uppfattning, inklusive men inte begränsat till, vad denne anser vara sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.

Förvaltaren övervakar regelbundet att ett företag som fonden har investerat i upprätthåller praxis för god styrning genom att använda allmänt tillgänglig information som exempelvis bokslut och rapporter som lämnats av ett företag, investerarevenemang och möten som anordnas av ett företag, branschinformation och annan sådan information som förvaltaren har identifierat som den anser är väsentlig. Praxis för god styrning i investeringsobjekten följs upp löpande.

Investeringsstrategin styr

investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Praxis för god styrning

omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.



Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?

Fonden är en aktivt förvaltnad aktiefond med inriktning mot globala storbolag. Fonden förbinder sig ej att göra hållbara investeringar, men vid fondens bolagsval tar förvaltaren inte bara hänsyn till ekonomisk avkastning utan även till miljö-, sociala- och bolagsstyrningsfaktorer i investeringsprocessen. På så sätt främjas hållbarhetsrelaterade egenskaper i fonden. Således består fondens tillgångsallokering av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1 och Nr 2. Tillgångsallokeringen kan förändras över tid och procentsiffran ska därför betraktas som ett genomsnitt över en längre tidsperiod.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

[inkludera anmärkning endast för de finansiella produkter som avses i artikel 6 i förordning (EU) 2020/852]

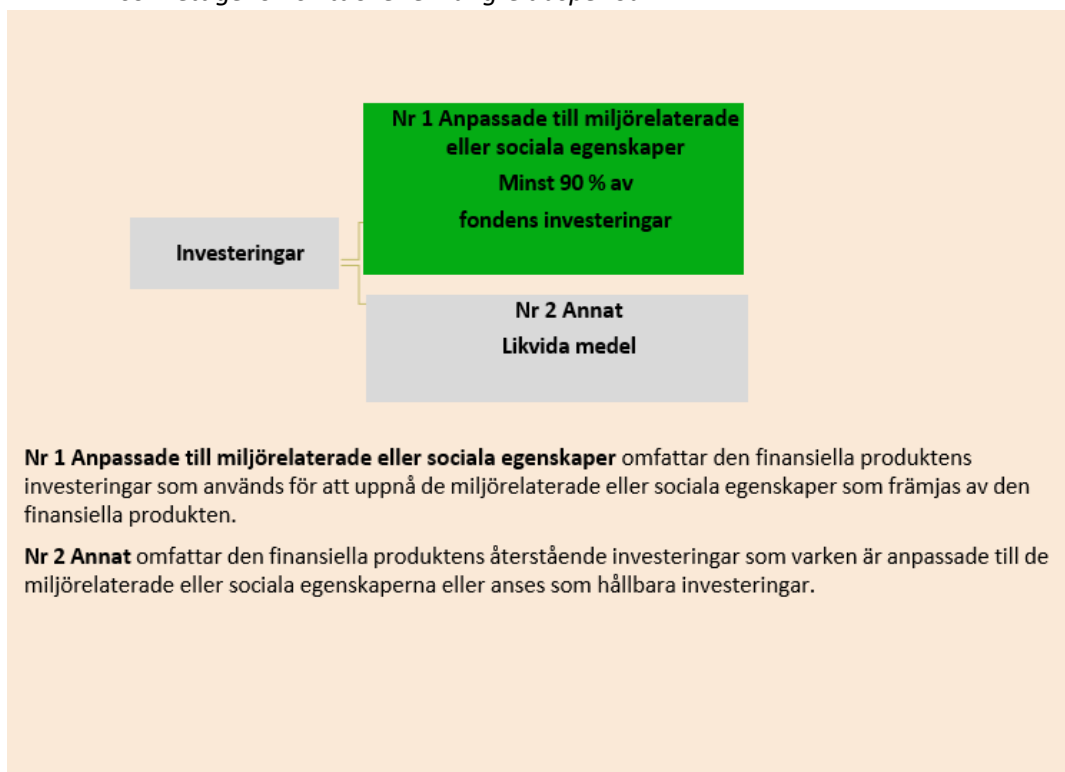
Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **omsättning**, vilket återspeglar andelen av intäkterna från investeringsobjektens gröna verksamheter
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjektet, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

[inkludera anmärkning endast för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]

Möjliggörande verksamheter gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

Omställningsverksamheter är verksamheter som det ännu inte finns koldioxidsnåla alternativ tillgängliga för och som bland



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

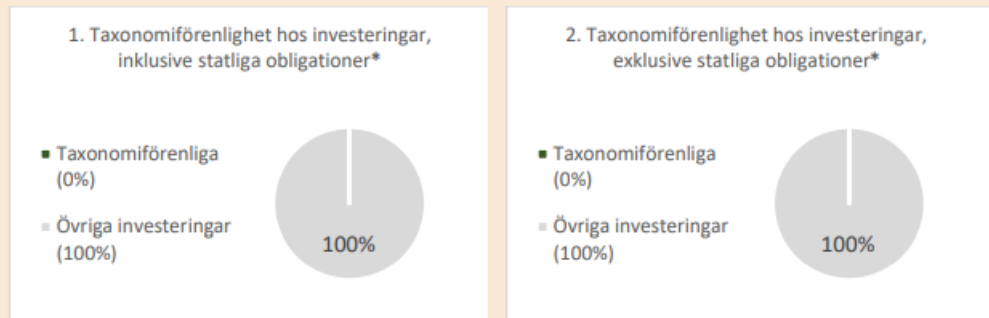
Nr 2 Annat omfattar den finansiella produktens återstående investeringar som varken är anpassade till de miljörelaterade eller sociala egenskaperna eller anses som hållbara investeringar.

- **Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?** Fonden placerar för närvarande ej i derivatinstrument utan placerar uteslutande i aktier.



Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med kraven i EU-taxomin? Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar.

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomianpassade statliga obligationer är*, visar den första grafen taxonomianpassningen med avseende på alla den finansiella produktens investeringar, inklusive statliga obligationer, medan den andra grafen visar taxonomianpassningen endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statliga obligationer.



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

- **Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar och har inte fastställt någon minimiandel för investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin? Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar? Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar.



Vilka investeringar är inkluderade i "Nr 2 Annat", vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder? Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" ingår sådana likvida medel som behövs för förvaltningen av fonden.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt överensstämmer med de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna som den främjar? Inget specifikt index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som fonden främjar.

- **Hur anpassas referensvärdet löpande till var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten?** Inte tillämpligt
- **Hur säkerställs kontinuerlig anpassning av investeringsstrategin till indexets beräkningsmetod?** Inte tillämpligt
- **Hur skiljer sig det valda referensvärdet från ett relevant brett marknadsindex?** Inte tillämpligt

[inkludera anmärkning för finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 som investerar i miljörelaterade ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter]



är hållbara investeringar med ett miljömål som inte beaktar kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter

EU. [inkludera anmärkning för finansiella produkter där ett index har valts som referensvärde för uppnåendet av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten]

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

- **Var kan man hitta den metod som används för beräkningen av det valda indexet? Inte tillämpligt**



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer produktspecifik information finns på webbplatsen:
<https://aifmgroup.com/sensum-strategy-global/>