

FIM FONDER

HÅLLBARHETSRAPPORT 31.03.2021

FIM Optimal Ränta

Specialplaceringsfond som investerar i olika räntesegment

Portföljens ESG-poäng 6,20

Delområdespoäng

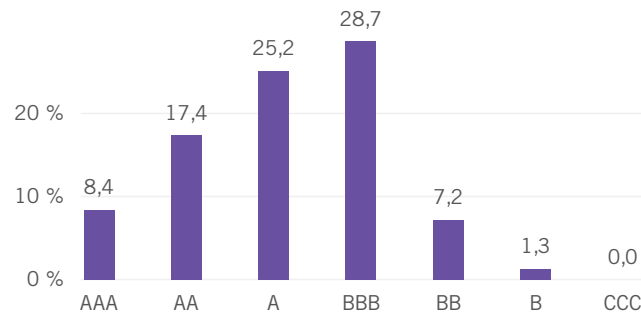
Miljö (E)	5,41
Social (S)	6,06
Bolagsstyrning (G)	5,99

Omfattning av portföljens marknadsvärde 88,01 %

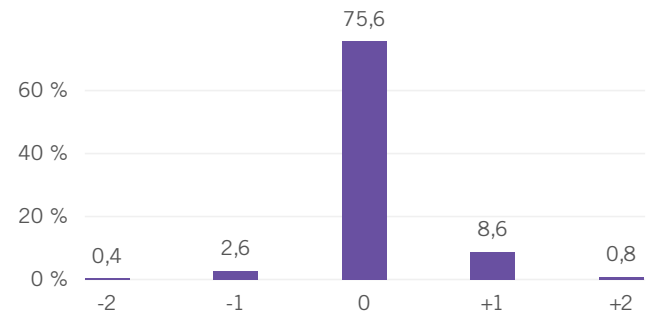
Portföljens ESG-klassificering

AAA	Urmärkt
AA	Berömlig
A	God
BBB	Genomsnitt
BB	Nöjaktig
B	Svag
CCC	Mycket svag

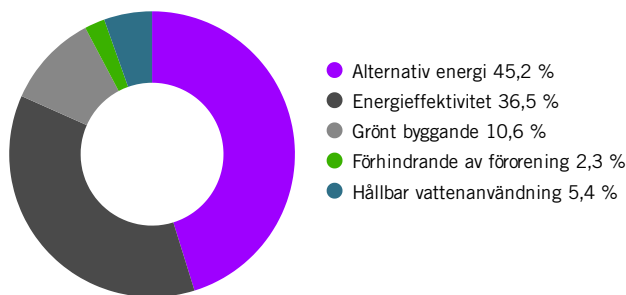
ESG-klassificeringarnas distribution i portföljen



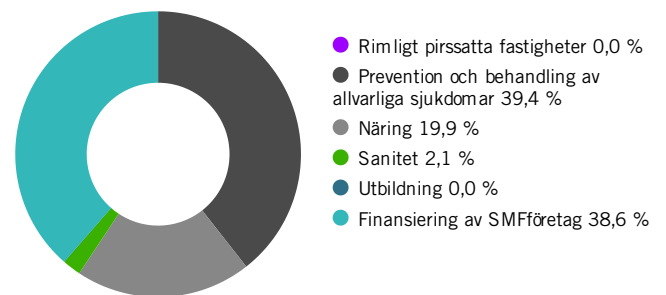
ESG-klassificeringarnas förändring i portföljen



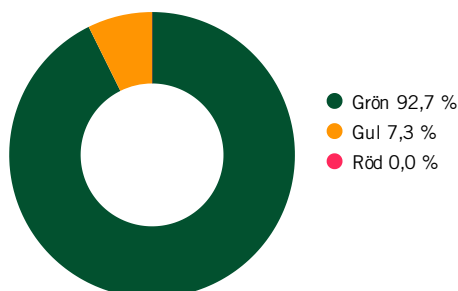
Positiv miljöpåverkan 1,29%



Positiv social påverkan 1,86%



FN:s Global Compact-principer



Omfattning av portföljens marknadsvärde 40,65%

I portföljens hållbarhetsrapport uppskattas hur väl företagen i portföljen tar i beaktande ESG-faktorer, det vill säga faktorer relaterade till miljö (Environmental), socialt ansvar (Social) och bolagsstyrning (Governance). I rapporten utnyttjas data från MSCI ESG Research.

Portföljens ESG-poäng anger hur väl företagen i portföljen beaktar risker och möjligheter relaterade till miljö, socialt ansvar och bolagsstyrning. Vid beräkningen utnyttjas företagens företagsspecifika poäng, som är branschjusterade. Portföljens ESG-poäng är ett vägt medeltal av de företagsspecifika poängen. Bedömningskalan går från 1–10. Ju högre poäng, desto bättre beaktar företagen i portföljen ESG-faktorer. Oklassificerade företag har lämnats utanför beräkningen och de klassificerade företagens vikt i portföljen har omskalats.

Portföljens ESG-klassificering ges på basis av portföljens ESG-poäng. Poängsättningen är indelad i sju klasser. Klassificeringsklasserna från den bästa till den sämsta är AAA, AA, A, BBB, BB, B, CCC.

Delområdespoängen anger hur väl företagen i portföljen presterar på respektive ESG-delområde. Portföljens totalpoäng är inte ett vägt medeltal av delområdespoängen, eftersom delområdespoängen är absoluta poäng och beräknas utan branschjustering.

Omfattning av portföljens marknadsvärde anger hur stor andel av portföljens innehav som omfattas av MSCI:s ESG analys.

ESG-klassificeringarnas distribution i portföljen visar hur fördelningen mellan de olika ESG-klassificeringarna ser ut i portföljen. Oklassificerade företag är inte beaktade i grafen, men investeringarnas verkliga vikt har använts vid beräkningen.

ESG-klassificeringarnas förändring i portföljen anger den realiserade förändringen (12 mån) av portfölj innehavens klassificeringar. Skalan anger hur många nivåer klassificeringen har stigit eller sjunkit under de senaste 12 månaderna. +2 innebär till exempel att klassificeringen har stigit med två nivåer. 0 innebär att klassificeringen inte har förändrats. Oklassificerade företag är inte beaktade i grafen, men investeringarnas verkliga vikt har använts vid beräkningen.

Positiv miljöpåverkan anger hur stor andel av portfölj innehavens omsättning som härstammar från för miljön positiv verksamhet. Verksamhet som har en positiv påverkan på miljön är i detta fall på förhand definierad verksamhet, som har en positiv påverkan på miljön eller som skapar miljölösningar. Portföljens positiva miljöpåverkan har beräknats som en procentandel av hela portföljens omsättning. Grafen anger i sin tur av vilka komponenter den som procentandel angivna positiva miljöpåverkan består av samt komponenternas distribution.

Positiv social påverkan anger hur stor andel av portfölj innehavens omsättning härstammar från verksamhet som har en positiv social påverkan. Verksamhet som har en positiv social påverkan är i detta fall på förhand definierad verksamhet, som skapar lösningar för sociala utmaningar. Portföljens positiva sociala påverkan har beräknats som en procentandel av hela portföljens omsättning. Grafen anger i sin tur av vilka komponenter den som procentandel angivna positiva sociala påverkan består av samt komponenternas distribution.

FN:s Global Compact-principer grafen anger hur väl bolagen i portföljen följer FN:s Global Compact principer. FN:s Global Compact -initiativ består av tio principer angående mänskliga rättigheter, arbetsrätt, miljö och antikorrupcion. Bolagen i portföljen indelas i tre klasser enligt normöverträdelse och allvarlighetsgrad; grön, gul och röd. Grön innebär att bolaget inte inom de senaste tre åren har förknippats med händelser som enligt MSCI metodologi innebär överträdelse av Global Compact-principerna. Gul innebär att bolaget bevakas av MSCI på grund av något/några kontroversiella händelser. Röd innebär att bolaget är förknippat med en eller flera händelser som orsakat att bolaget åtalats för att bolaget eller dess ledning har orsakat allvarlig och storskalig skada och agerat mot Global Compact principerna.