

Hållbarhetsinformation

HÅLLBARHETSINFORMATION

Bakgrund

Fondbolag ska, enligt 4 kap. 24 § lagen om värdepappersfonder, lämna information om fondens förvaltning med avseende på hållbarhet. Information om vilka hållbarhetsaspekter som beaktas och vilka metoder som används ska lämnas i fondens informationsbroschyr, samt i årsberättelsen eller en separat rapport. En uppföljning av hållbarhetsarbetet ska redovisas i årsberättelsen eller i en separat rapport. Informationen ska lämnas för varje svensk värdepappersfond, oavsett om den förvaltas av ett svenskt eller utländskt fondbolag. Motsvarande krav gäller, enligt 10 kap. 11 § lagen om förvaltare av alternativa investeringsfonder, för AIF-förvaltare som förvaltar en specialfond eller annan fond som marknadsförs till icke-professionella investerare i Sverige.

För vissa av de fonder som Bolaget förvaltar tillämpas hållbarhetskriterier. Information om hållbarhetskriterier för fonder som förvaltas av Bolagets finns i respektive fonds informationsbroschyr, i tillämpliga fall.

Chelonia Market Neutral

Bolaget har inom ramen för förvaltning av fonden Chelonia Market Neutral antagit nedanstående hållbarhetspolicy.

Hållbarhet i investeringsprocessen

Förvaltarna beaktar hållbarhetsaspekter i förvaltningen av fonden Chelonia Market Neutral.

Fondens investeringsfilosofi har en stark fundamental orientering med utgångspunkt i de enskilda företagen och dess värdering. Analysen syftar till att identifiera företagsspecifika långa och korta positioner med potential till attraktiv riskjusterad avkastning. Då Chelonia Market Neutral är en hedge fond anser Förvaltaren att det är förenligt att kunna blanka aktier i bolag som Förvaltaren bedömer inte beaktar hållbarhetsaspekter.

SRI (Socially Responsible Investing) eller ansvarsfulla investeringar syftar till att beakta ESG (Environmental, Social and Governance) faktorer som miljö, socialt ansvar och affärsetiska frågor i investeringsbeslut för att hantera risk och generera en hållbar, långsiktig avkastning. Att analysera och beakta alla former av risker och möjligheter, oavsett vad de kallas för, är sunt förnuft och ingår i en portföljförvaltares arbetsbeskrivning. Sålunda gäller detta även ESG-faktorer.

Hållbarhetsaspekter som beaktas i förvaltningen av fonden är bolagens inverkan på miljö och klimat, mänskliga rättigheter, arbetstagar rättigheter och likabehandling samt bolagsstyrningsaspekter såsom ersättningspolicy, aktieägares rättigheter och motverkan av korruption.

För korta positioner kan bristande hantering/policy för hållbarhetsfrågor och/eller brister i bolagsstyrning vara grund för positionering.

De metoder som förvaltarna använder är:

Väljer in: Förvaltarna av fonden väljer in och tar hänsyn till hållbarhetsfrågor dvs hållbarhetsaspekter beaktas i bolagsanalyser och investeringsbeslut, vilket får effekt men behöver inte vara avgörande för vilka bolag som väljs in i fonden.

Väljer bort: Fonden placerar inte i bolag involverade i vissa produkter och tjänster. Kemiska och biologiska vapen, kärnvapen, tobak och fossila bränslen. Högst 5% av omsättningen i bolag där placering sker får avse verksamhet hänförligt till dessa produkter och tjänster. Fonden är en hedgefond och kan däremot blanka bolag verksamma inom följande sektorer och övriga produkter/tjänster/annat som förvaltaren väljer att inte investera i.

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.

Eventuella rödflaggade innehav utsluts inte per automatik om det finns goda investeringsmässiga anledningar att inneha ett bolag, exempelvis om ledningen är medveten om problematiken och ämnar åtgärda den, och portföljförvaltaren bedömer att hållbarhetsarbetet kommer återspeglas i värderingen.

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

Påverkar: Förvaltaren avser påverka i bolag som fonden äger under en mellan- eller långfristig tidsperiod (mer än 1 år), genom samarbete med andra investerare och/eller bolagsstämmor, i de fall bolaget inte uppfyller hållbarhetsaspekter som belysts ovan.

Resurser för hållbarhetsanalys, uppföljning och kontroll.

Fonden använder sig främst av interna resurser för hållbarhetsanalys och bolagspåverkan. Vi tar också del av externa leverantörers växande kapacitet inom hållbarhetsanalys.

I de fall vi inte har tillräcklig kunskap om en specifik nyckelfaktor inom hållbarhet, utbildas investeringsorganisationen externt och/eller inhämtar relevant information från exempelvis konsulter och andra motparter.

Mer information om fonden och dess hållbarhetsarbete finns i fondens informationsbroschyr, årlig hållbarhetsuppföljning och bolagets "Standard för hållbarhetsinformation".

Information om fonden återfinns även i fondens faktablad och Fondbestämmelser.

Denna information har senast uppdaterats i oktober 2020.