

Hållbarhetsöversikt

AMF Fonder



1. Hållbarhet för oss

AMF Fonder förvaltar cirka 130 miljarder kronor*. Vi har en hög ambition att investera ansvarsfullt i vår förvaltning. Vi tror att bolag som drivs på ett långsiktigt hållbart sätt har bäst förutsättningar att över tid generera god avkastning till våra sparare. Våra fonder är aktivt förvaltade och vårt utbud består av aktiefonder, räntefonder och en blandfond. Fondernas målsättning är att med god risk-spridning på lång sikt uppnå en värdetillväxt som överstiger genomsnittet för de marknader som fonden kan placera på.

AMF Fonder AB är ett dotterbolag till AMF Pensionsförsäkring AB (AMF) och en stor del av hållbarhetsarbetet bedrivs för dessa bolag gemensamt.

Vi är aktiva ägare i de svenska bolag där innehaven är betydande. Vi deltar i valberedningar och röstar på bolagsstämmor samt tar upp relevanta hållbarhetsfrågor i kontakter med bolagen. För utländska aktier strävar vi efter att investera i de bolag som bedöms vara de mest hållbara inom respektive bransch samt röstar på de största innehaven. Vi samarbetar även med andra investerare i internationella påverkansinitiativ.

AMF har skrivit under UN PRI, FN:s principer för ansvarsfulla investeringar. Vi följer även de internationella konventioner som FN tagit fram gällande mänskliga rättigheter, arbetsrätt, miljö och antikorrruption.

* per 2020-03-31.

2. Hållbarhet i investeringsprocessen

Vid investeringar i svenska aktier så tar förvaltaren hänsyn till hållbarhetsaspekter i investeringsbesluten. Förvaltaren använder sig av externa hållbarhetsanalyser. Förvaltaren kan även göra en egen bedömning om bolaget inte är täckt av analysföretagen.

I de svenska bolag där AMF Fonder är stora ägare deltar AMF Fonder ofta i valberedningar, på bolagsstämmor samt i möten med bolagsledningarna. AMF publicerar årligen en ägarstyrningsrapport om aktuella frågor och AMFs påverkansarbete, både i svenska och utländska bolag. Läs rapporten här: amf.se/om-amf/hallbarhet/ansvarsfulla-investeringar/agarstyrning

För investeringar i utländska aktier söker AMF Fonder aktivt bland de bolag som bedöms som mest hållbara inom respektive bransch. Till vår hjälp har vi tillgång till extern hållbarhets-

analys. Referensindex för utländska aktieinvesteringar är MSCI All Country World Index ESG NR. Indexet omfattar de bolag inom respektive sektor som har kommit längst i sitt hållbarhetsarbete gällande miljöfrågor, sociala frågor och bolagsstyrning.

AMF strävar efter att bidra till en långsiktig hållbar samhällsutveckling i linje med FN:s hållbarhetsmål (Agenda 2030), samt stödjer Parisavtalet om en begränsning av den globala uppvärmningen till under två grader. Vid alla investeringar ska bolagens koldioxidavtryck beaktas i investeringsbeslutet. Därutöver ska AMF helt undvika investeringar i bolag där utvinning av förbränningskol överstiger 5 procent av bolagets omsättning.

AMF Fonder mäter och redovisar koldioxidavtrycket från samtliga fonder med aktieinnehav, enligt Fondbolagens förenings branschstandard. Koldioxidavtrycket redovisas per fond. Inför varje ny investering så beaktar fondförvaltarna de enskilda bolagens koldioxidavtryck.

AMF Fonder investerar inte i bolag som producerar eller distribuerar tobak eller pornografi. AMF Fonder investerar heller inte i bolag vars kärnverksamhet är att bedriva kommersiell spelverksamhet (hasardspel).

Hela AMF Fonders innehav av svenska och utländska aktier samt företagsobligationer granskas två gånger om året utifrån internationella normer och konventioner. Granskningen genomförs av en extern leverantör.

3. Hållbarhet i ägararbetet

Syftet med vårt ägararbete är att skapa förutsättningar för en långsiktigt god avkastning för spararna. AMFs ambition är att vara en aktiv ägare där vi bedömer att det gynnar våra sparare. Omfattningen av påverkansarbetet är baserat dels på bolagets storlek i portföljen samt vilka prioriterade områden AMF väljer att agera på. AMF ska så långt som möjligt säkerställa att styrelserna och ledningarna i våra innehav, identifierar och proaktivt hanterar relevanta hållbarhetsfrågor. AMF arbetar bl. a. med att jobba för att bolagen skall ha jämställda styrelser.

Sammanlagt har AMF och AMF Fonder deltagit på 51 bolagsstämmor under 2019 samt arbetat i 28 valberedningar i Sverige. I utlandet har AMF Fonder röstat på 132 bolagsstämmor via proxyröstning.

Läs mer om ägarstyrning här:

amf.se/om-amf/hallbarhet/ansvarsfulla-investeringar/agarstyrning



4. Hållbarhets- och temafonder

Hållbarhetsarbetet genomsyrar hela fondförvaltningen. AMF Fonder har ingen fond med särskilt hållbarhetstema.

5. Resurser och åtaganden för hållbarhet

Vi har en hållbarhetsansvarig inom kapitalförvaltningen och en på fondbolaget som hjälper förvaltarna med hållbarhetsfrågor, processer med mera. Inom koncernen finns en övergripande hållbarhetsansvarig. Förvaltarna använder sig främst av ESG analyser från MSCI och Sustainalytics i investeringsprocessen.

AMF är medlem i följande organisationer: UN PRI, FNs Global Compact, CDP, Net-Zero Asset Owner Alliance, Climate Action 100+, Montreal Carbon Pledge, SWESIF, Hållbart värdeskapande, Institutionella Ägares Förening, Swedish Investors for Sustainable Development.

AMF stödjer följande konventioner:

- OECDs riktlinjer för multinationella företag.
- Konventionen mot klustervapen (CCM).
- Kemvapenkonventionen (CWC).
- Konventionen om förbud mot biologiska vapen (BTWC).
- Ickespridningsfördraget (NPT).

6. Vill du veta mer?

amf.se/vara-fonder/ansvarsfulla-investeringar

amf.se/om-amf/hallbarhet

amf.se/om-amf/hallbarhet/ansvarsfulla-investeringar/agarstyrning