

Hållbarhetsrapport Private Equity Mix 1

Rapporteringsperiod: 8 december till 31 december 2021

Private Equity Mix 1 främjar miljömässiga och sociala egenskaper. Private Equity Mix 1 har inte hållbara investeringar som mål och åtar sig inte att göra hållbara investeringar. Därmed genomförs ingen bedömning av hur stor andel av de underliggande investeringarna som tar EU:s kriterier för miljömässigt hållbara aktiviteter i beaktning.

Private Equity Mix 1s miljömässiga och sociala egenskaper

Tillgångarna i Private Equity Mix 1 placeras i investeringsalternativ som förvaltas av flera olika kapitalförvaltare. Nordea Liv & Pension säkerställer att Private Equity Mix 1 främjar miljömässiga och sociala egenskaper genom att bedöma hur dessa kapitalförvaltare har integrerat miljö-, sociala- och bolagsstyrningsfaktorer (ESG) i sin process för investeringsbeslut och hur specifika investeringsalternativ förhåller sig till ESG-faktorer.

Tillgångarna i denna produkt har investerats genom kapitalförvaltare som har utvärderats baserat på deras hållbarhetsarbete och hur väl de har uppnått Nordea Liv & Pensions standarder för hållbarhet.

Nordea Liv & Pension använder specifika betygssättningsmetoder för att utvärdera kapitalförvaltarna i deras hållbarhetsarbete. Betygssättningen baseras på intervjuer samt ett frågeformulär gällande ansvarsfulla investeringar som kapitalförvaltarna besvarar. Med stöd av svaren och möten med kapitalförvaltarna gör Nordea Liv & Pension en detaljerad bedömning för att kunna betygssätta nivån på integration av ESG i kapitalförvaltningen. Betyget baseras på följande områden:

- Målsättning och åtaganden för hållbarhet
- Polycys och styrning
- ESG-integration, resurser och research
- Aktivt ägandeskap och styrelsearbete
- Miniminivåer för ESG

Nordea Liv & Pension har minimikrav gällande miljömässiga och sociala faktorer som Private Equity Mix 1 ska efterleva. Detta betyder att sektorer och företag med betydande exponering mot vissa aktiviteter som anses skadliga för miljön och/eller samhället i stort är exkluderade. Nordea Liv & Pension använder screening, löpande rapportering och uppföljningsmöten med kapitalförvaltare för att säkerställa att Private Equity Mix 1 investeras i enlighet med minimikraven.

Översikt av ESG-relaterade aktiviteter inom Nordea Liv & Pension under 2021

Nordea Liv & Pension har under 2021 stärkt strukturen för styrning av ESG-frågor och hållbarhetsrisker genom att etablera en nordisk Hållbarhetskommitté och ett team för ansvarsfulla investeringar (Responsible Investment team (RI-team)). Hållbarhetskommittén ger råd och rekommendationer kring hållbarhetsrelaterade aktiviteter och investeringsbeslut. RI-teamet är ansvariga för dagliga aktiviteter kopplat till ESG och har veckovisa möten för att diskutera både hållbarhetsrisker och möjligheter avseende sparprodukter som Nordea Liv & Pension erbjuder.

Nordea Liv & Pension är medgrundare till det FN-ledda initiativet Net Zero Asset Owner Alliance. Genom detta initiativ har Nordea Liv & Pension, tillsammans med andra internationella institutionella investerare åtagit sig att ställa om sina investeringsportföljer till att vara helt utsläppsneutrala senast år 2050. Det innebär att utsläppen måste halveras till år 2030 och Nordea Liv & Pension har därför även åtagit sig att sätta delmål vart femte år. Det första delmålet är satt till 2025 och innebär att Nordea Liv & Pension ska minska sina portföljutsläpp med minst 25 procent jämfört med 2019. Därtill har Nordea Liv & Pension satt ett krav att samtliga av Nordea Liv & Pensions utsedda förvaltare ska ha åtagit sig att ställa om sina respektive investeringsportföljer till nettonoll 2050 senast 2024 för att få fortsätta förvalta kapital åt Nordea Liv & Pension.

Nordea Liv & Pensions investeringsteam bevakar hållbarhetsrisker i de sparprodukter vi erbjuder genom att kontinuerligt träffa de kapitalförvaltare som förvaltar tillgångar för Nordea Liv & Pension och diskuterar relevanta ESG-frågor med dem.