

# Årsberättelse 2023

Fonder förvaltade av Avanza Fonder AB

# Helårsberättelse 2023

|   |     |
|---|-----|
| Avanza 50 .....   | 1   |
| Avanza 75 .....   | 6   |
| Avanza 100 .....  | 11  |
| Avanza Auto 1 .....   | 16  |
| Avanza Auto 2 .....   | 21  |
| Avanza Auto 3 .....   | 26  |
| Avanza Auto 4 .....   | 31  |
| Avanza Auto 5 .....   | 36  |
| Avanza Auto 6 .....   | 41  |
| Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest .....                    | 46  |
| Avanza Emerging Markets .....                                       | 52  |
| Avanza Europa .....   | 57  |
| Avanza Fastighet by Norhammar .....                                 | 62  |
| Avanza Global .....   | 67  |
| Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult .....                        | 72  |
| Avanza Impact by Circulus .....                                     | 77  |
| Avanza Ränta Global .....   | 83  |
| Avanza Ränta Kort .....   | 87  |
| Avanza Småbolag by Skoglund .....                                   | 91  |
| Avanza Sverige .....  | 95  |
| Avanza USA .....  | 101 |
| Avanza World Tech By TIN .....                                      | 105 |
| Avanza Zero .....   | 109 |
| Information om Avanza Fonder .....                                  | 115 |
| Styrelsens underskrifter .....                                      | 116 |
| Revisionsberättelse .....   | 117 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Auto 4 .....                              | 121 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Auto 6 .....                              | 132 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Auto 3 .....                              | 143 |
| Hållbarhetsrapport Avanza 50 .....                                  | 154 |
| Hållbarhetsrapport Avanza 75 .....                                  | 166 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Auto 5 .....                              | 177 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Auto 2 .....                              | 188 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Auto 1 .....                              | 199 |
| Hållbarhetsrapport Avanza 100 .....                                 | 210 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest ..... | 221 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Emerging Markets .....                    | 231 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Europa .....                              | 235 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Fastighet by Norhammar .....              | 246 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Global .....                              | 256 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult .....     | 260 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Impact by Circulus .....                  | 271 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Ränta Global .....                        | 284 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Ränta Kort .....                          | 296 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Småbolag by Skoglund .....                | 308 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Sverige .....                             | 319 |
| Hållbarhetsrapport Avanza USA .....                                 | 331 |
| Hållbarhetsrapport Avanza World Tech By TIN .....                   | 342 |
| Hållbarhetsrapport Avanza Zero .....                                | 353 |

*Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.*

# Avanza 50

Avanza 50 är en fondandelsfond och har som mål att uppnå en god avkastning på lång sikt genom att placera mellan 40 procent och 60 procent av fondförmögenheten i aktierelaterade tillgångar. De underliggande fonderna ska ge en bred exponering mot de svenska och globalaktiemarknaderna.

Avanza 50 är en specialfond vilket innebär att fonden har friare placeringsregler än traditionella värdepappersfonder.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 10,5 procent, vilket var sämre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 11,0 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 325,9 miljoner kronor till 370,0 miljoner kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Aktieexponeringen har utgjort omkring 50 procent av kapitalet, vilket är normalfallet för fonden. Det har kombinerats med cirka 50 procent exponering mot räntebärande instrument med blandade löptider i syfte att minska fondens svängningar och därmed den totala risken i fonden. Den globala aktieexponeringen har kombinerats med en relativt högre vikt mot svenska aktiemarknaden jämfört med ett globalt aktieindex.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

Lägst hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risken för fonden är exponerad mot den marknadsrisken som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av

## Fondfakta

|  |                                  |
|--|----------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2012-10-25                       |
| Andelsvärde  | 195,11                           |
| Fondförmögenhet, tkr   | 369 984                          |
| Utveckling, %  | 10,50                            |
| Utv. jämförelseindex, %  | 11,03                            |
| Kursnotering   | Daglig                           |
| Inträdesavgift   | Ingen                            |
| Utträdesavgift   | Ingen                            |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,57                             |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,49                             |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                             |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %                                    | 1,50                             |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,20                             |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                  |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning    |
| Förvaltare   | Peter Stengård, Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-5859                      |
| <sup>1)</sup> Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, % |                                  |

| Fondens 5 största innehav        | Exponering, tkr | % av fond |
|----------------------------------|-----------------|-----------|
| Öhman Obligationsfond SEK A      | 45 273          | 12,24 %   |
| Swedbank Robur Räntefond Kort    | 44 164          | 11,94 %   |
| Danske Invest Sverige Kort Ränta | 40 528          | 10,95 %   |
| Swedbank Robur Access Global     | 33 374          | 9,02 %    |
| Amundi Index Msci World SRI      | 32 305          | 8,73 %    |

bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk då somliga av fondens innehav kan vara svåra att likvidera. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

### Aktivitetsgrad

Avanza 50s jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 45 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK, 5 procent Morningstar Sweden NR SEK, 25 procent NASDAQ OMRX Total Bond SEK och 25 procent NASDAQ OMRX Treasury Bill TR SEK. Det sammansatta indexet är relevant då det speglar Avanza 50s långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångsslag.

Avanza 50 är en fondandelsfond där förvaltaren väljer vilka fonder som Avanza 50 placerar i. Detta innebär att fondens avkastning över tid kommer att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken kan därmed bli olika år från år.

Avanza 50 har ungefär hälften av sitt kapital investerat i räntefonder, och genom en lägre aktiv risk i sina ränteplaceringar i förhållande till jämförelseindex kan Avanza 50 uppvisa en lägre aktiv risk jämfört med exempelvis Avanza 75 och Avanza 100 som har en större andel av sitt kapital investerat i aktiefonder.

Avanza 50 har avvikit från jämförelseindex i förväntad omfattning. Sett till den senaste 24-månadersperioden, som redovisas under 2023, förklaras den minskade aktiva risken av bland annat att förvaltaren har investerat i tillgångar som återfinns i jämförelseindex. Bedömningen är att Avanza 50s aktiva risk ligger inom det spann som den bör ligga inom. För information om den aktiva risken se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

### Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året. Fonden ändrade i samband med det sina fondbestämmelser och fonden gavs möjlighet att investera i derivat.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|---|---------------|----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 35 320        | -29 368        |
| Övriga finansiella intäkter               | 796           | 633            |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>36 116</b> | <b>-28 735</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
| Förvaltningskostnader                     | -1 695        | -1 660         |
| Övriga finansiella kostnader              | -12           | -13            |
| Övriga kostnader                          | -             | -4             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-1 707</b> | <b>-1 677</b>  |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>34 409</b> | <b>-30 412</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 365 991           | 324 440           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>365 991</b>    | <b>324 440</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 4 290             | 1 763             |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 151               | 144               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>370 432</b>    | <b>326 347</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 448               | 410               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>448</b>        | <b>410</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>369 984</b>    | <b>325 937</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|--|---------------|----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |               |                |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |               |                |
| Realisationsvinster                          | 7 910         | 4 193          |
| Realisationsförluster                        | -1 097        | -187           |
| Orealiserade vinster/förluster               | 28 507        | -33 374        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>35 320</b> | <b>-29 368</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 325 937           | 371 692           |
| Andelsutgivning                           | 54 337            | 39 968            |
| Andelsinlösen                             | -44 699           | -55 311           |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 34 409            | -30 412           |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>369 984</b>    | <b>325 937</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 369 984    | 325 937    | 371 692    | 314 666    | 304 479    |
| Andelsvärde              | 195,11     | 176,57     | 192,63     | 169,71     | 165,70     |
| Antal utestående andelar | 1 896 326  | 1 845 916  | 1 929 585  | 1 854 187  | 1 837 516  |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 10,50      | -8,34      | 13,51      | 2,42       | 15,43      |
| Jämförelseindex, %       | 11,03      | -5,75      | 14,00      | 2,30       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 1,16       | 1,33       | 1,21       | -          | -          |

|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 224 651    | 207 179    | 148 508    | 114 933    | 64 095     |
| Andelsvärde              | 143,55     | 145,90     | 136,75     | 126,66     | 124,02     |
| Antal utestående andelar | 1 564 924  | 1 419 984  | 1 085 970  | 907 384    | 516 804    |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | -1,62      | 6,69       | 7,97       | 2,13       | 11,59      |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          | -          | -          | -          |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 3,25                    | 1 356,26      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 51,76                   | 11 050,01     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,20  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,49  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,57  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 11,94 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,01  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 7,84  |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 7,66  |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 0,64  |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 6,33  |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltningsfonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

### Övriga finansiella instrument

98,92 %

| Värdepapper  | Antal   | Kurs     | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|--|---------|----------|--------------------|----------------------|
| <b>Fondandelar</b>                                 |         |          |                    |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                                 |         |          |                    |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI             | 70 434  | 105,17   | 7 407 570          | 2,00 %               |
| Amundi Index Msci World SRI                        | 200 604 | 161,04   | 32 305 296         | 8,73 %               |
| Avanza Sverige                                     | 183 858 | 82,74    | 15 212 395         | 4,11 %               |
| East Capital Global Emerging Markets Sustainable C | 77 470  | 96,42    | 7 469 381          | 2,02 %               |
| Handelsbanken Global Index Crit                    | 69 106  | 463,37   | 32 021 433         | 8,65 %               |
| Storebrand Aktiefond Global A                      | 138 494 | 226,46   | 31 363 246         | 8,48 %               |
| Storebrand Aktiefond Sverige                       | 15 476  | 480,41   | 7 434 789          | 2,01 %               |
| Swedbank Robur Access Global                       | 126 292 | 264,26   | 33 373 966         | 9,02 %               |
| Swedbank Robur Access Sverige                      | 27 904  | 281,42   | 7 852 783          | 2,12 %               |
| Öhman Etisk Emerging Markets                       | 34 115  | 223,14   | 7 612 396          | 2,06 %               |
|  |         |          | <b>182 053 256</b> | <b>49,21 %</b>       |
| <b>Räntefonder</b>                                 |         |          |                    |                      |
| Captor Global Fixed Income A                       | 108 444 | 205,04   | 22 235 501         | 6,01 %               |
| Captor Perenne Short Term Bond A                   | 26 250  | 200,35   | 5 259 235          | 1,42 %               |
| Danske Invest Sverige Kort Ränta                   | 32 773  | 1 236,64 | 40 528 121         | 10,95 %              |
| Storebrand Obligation A                            | 181 367 | 145,99   | 26 477 426         | 7,16 %               |
| Swedbank Robur Räntefond Kort                      | 423 675 | 104,24   | 44 163 899         | 11,94 %              |
| Öhman Obligationsfond SEK A                        | 465 153 | 97,33    | 45 273 326         | 12,24 %              |
|  |         |          | <b>183 937 508</b> | <b>49,72 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                           |         |          | <b>365 990 764</b> | <b>98,92 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>               |         |          | <b>365 990 764</b> | <b>98,92 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b>       |         |          | <b>3 992 938</b>   | <b>1,08 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                             |         |          | <b>369 983 702</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza 75

Avanza 75 är en fondandelsfond och har som mål att uppnå en god avkastning på lång sikt genom att placera mellan 65 och 85 procent av fondförmögenheten i aktierelaterade tillgångar. De underliggande fonderna ska ge en bred exponering mot de svenska och globalaktiemarknaderna.

Avanza 75 är en specialfond vilket innebär att fonden har friare placeringsregler än traditionella värdepappersfonder.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 14,2 procent, vilket var lägre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 14,4 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 11,6 miljarder kronor till 15,3 miljarder kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Under året har fonden inte genomfört några större förändringar inom aktiebeståndet, exponeringen mot teknik har minskat något. Ränteexponeringen har setts över och ändrats mot slutet av året där en större exponering mot globala krediter tagits.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risk fonden är exponerad mot är den marknadsrisk som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk då somliga av fondens innehav

## Fondfakta

|  |                                  |
|--|----------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2012-10-25                       |
| Andelsvärde  | 265,14                           |
| Fondförmögenhet, tkr   | 15 294 704                       |
| Utveckling, %  | 14,18                            |
| Utv. jämförelseindex, %  | 14,41                            |
| Kursnotering   | Daglig                           |
| Inträdesavgift   | Ingen                            |
| Utträdesavgift   | Ingen                            |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,59                             |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,49                             |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                             |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                             |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,06                             |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                  |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning    |
| Förvaltare   | Peter Stengård, Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-5867                      |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                  |

| Fondens 5 största innehav       | Exponering, tkr | % av fond |
|---------------------------------|-----------------|-----------|
| Amundi Index Msci World SRI     | 2 818 759       | 18,43 %   |
| Handelsbanken Global Index Crit | 2 716 341       | 17,76 %   |
| Swedbank Robur Access Global    | 2 704 602       | 17,68 %   |
| Storebrand Obligation A         | 1 008 836       | 6,60 %    |
| Öhman Obligationsfond SEK A     | 827 294         | 5,41 %    |



kan vara svåra att likvidera. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

### Aktivitetsgrad

Avanza 75s jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 65 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK, 10 procent Morningstar Sweden NR SEK, 12,5 procent NASDAQ OMRX Total Bond SEK och 12,5 procent NASDAQ OMRX Treasury Bill TR SEK. Det sammansatta indexet är relevant då det bäst speglar Avanza 75s långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångslag.

Avanza 75 är en fondandelsfond där förvaltaren väljer vilka fonder som Avanza 75 placerar i. Detta innebär att Avanza 75s avkastning över tid kommer att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken kan därmed bli olika år från år.

Avanza 75 har avvikit från sitt jämförelseindex i förväntad omfattning. Bedömningen är att Avanza 75s aktiva risk ligger inom det spann som den bör ligga inom. För information om den aktiva risken se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

### Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året. Fonden ändrade i samband med det sina fondbestämmelser och fonden gavs möjlighet att investera i derivat.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>      | <b>2022</b>       |
|---|------------------|-------------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 1 766 119        | -1 249 557        |
| Övriga finansiella intäkter               | 39 115           | 27 715            |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>1 805 234</b> | <b>-1 221 842</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>      | <b>2022</b>       |
| Förvaltningskostnader                     | -66 885          | -53 397           |
| Övriga finansiella kostnader              | -37              | -86               |
| Övriga kostnader                          | -                | -20               |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-66 922</b>   | <b>-53 502</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>1 738 312</b> | <b>-1 275 345</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 15 203 687        | 11 526 687        |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>15 203 687</b> | <b>11 526 687</b> |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 100 777           | 52 878            |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 8 268             | 7 095             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>15 312 732</b> | <b>11 586 660</b> |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 18 028            | 14 078            |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>18 028</b>     | <b>14 078</b>     |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>15 294 704</b> | <b>11 572 581</b> |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>      | <b>2022</b>       |
|--|------------------|-------------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                  |                   |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                  |                   |
| Realisationsvinster                          | 102 035          | 680 672           |
| Realisationsförluster                        | -16 265          | -18 785           |
| Orealiserade vinster/förluster               | 1 680 349        | -1 911 445        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>1 766 119</b> | <b>-1 249 557</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 11 572 581        | 10 885 302        |
| Andelsutgivning                           | 3 296 594         | 3 016 067         |
| Andelsinlösen                             | -1 312 783        | -1 053 445        |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 1 738 312         | -1 275 345        |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>15 294 704</b> | <b>11 572 581</b> |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 15 294 704 | 11 572 582 | 10 885 302 | 7 731 004  | 6 456 692  |
| Andelsvärde              | 265,14     | 232,21     | 261,35     | 215,79     | 207,83     |
| Antal utestående andelar | 57 685 594 | 49 835 766 | 41 650 615 | 35 826 387 | 31 067 037 |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 14,18      | -11,15     | 21,11      | 3,83       | 23,35      |
| Jämförelseindex, %       | 14,41      | -7,08      | 22,09      | 3,07       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 1,92       | 2,00       | 2,01       | -          | -          |
|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 4 099 933  | 3 122 848  | 1 910 994  | 942 342    | 336 217    |
| Andelsvärde              | 168,49     | 172,17     | 156,68     | 140,28     | 135,77     |
| Antal utestående andelar | 24 333 856 | 18 138 020 | 12 197 068 | 6 717 695  | 2 476 392  |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | -2,14      | 9,89       | 11,69      | 3,32       | 17,11      |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          | -          | -          | -          |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 3,28                    | 1 367,43      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 53,03                   | 11 418,11     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,06  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,49  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,59  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 36,72 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 11,27 |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 10,66 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 0,72  |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 9,49  |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyen vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyen är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltningsfonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                      |            |          |                       | 99,40 %              |
|--|------------|----------|-----------------------|----------------------|
| Värdepapper  | Antal      | Kurs     | Marknadsvärde         | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                                 |            |          |                       |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                                 |            |          |                       |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI             | 3 988 674  | 105,17   | 419 488 840           | 2,74 %               |
| Amundi Index Msci World SRI                        | 17 503 471 | 161,04   | 2 818 758 927         | 18,43 %              |
| Avanza Sverige                                     | 3 908 211  | 82,74    | 323 365 371           | 2,11 %               |
| East Capital Global Emerging Markets Sustainable C | 3 946 869  | 96,42    | 380 544 848           | 2,49 %               |
| FE Småbolag Sverige                                | 4 409 489  | 110,10   | 485 487 221           | 3,17 %               |
| Handelsbanken Global Index Crit                    | 5 862 142  | 463,37   | 2 716 340 558         | 17,76 %              |
| Humle Småbolagsfond A                              | 509 880    | 650,76   | 331 809 283           | 2,17 %               |
| Storebrand Aktiefond Sverige                       | 993 397    | 480,41   | 477 235 346           | 3,12 %               |
| Swedbank Robur Access Global                       | 10 234 623 | 264,26   | 2 704 601 527         | 17,68 %              |
| TIN W Tech B                                       | 3 273 561  | 129,43   | 423 695 271           | 2,77 %               |
| Öhman Etisk Emerging Markets                       | 1 679 539  | 223,14   | 374 772 260           | 2,45 %               |
|  |            |          | <b>11 456 099 451</b> | <b>74,90 %</b>       |
| <b>Räntefonder</b>                                 |            |          |                       |                      |
| Captor Global Fixed Income A                       | 222 605    | 205,04   | 45 643 221            | 0,30 %               |
| Captor Iris Bond A                                 | 3 013 067  | 258,95   | 780 233 337           | 5,10 %               |
| Captor Perenne Short Term Bond A                   | 26 250     | 200,35   | 5 259 235             | 0,03 %               |
| Danske Invest Sverige Kort Ränta                   | 290 983    | 1 236,64 | 359 840 857           | 2,35 %               |
| Storebrand Obligation A                            | 6 910 387  | 145,99   | 1 008 836 312         | 6,60 %               |
| Swedbank Robur Räntefond Kort                      | 6 911 748  | 104,24   | 720 480 656           | 4,71 %               |
| Öhman Obligationsfond SEK A                        | 8 499 884  | 97,33    | 827 293 720           | 5,41 %               |
|  |            |          | <b>3 747 587 337</b>  | <b>24,50 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                           |            |          | <b>15 203 686 788</b> | <b>99,40 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>               |            |          | <b>15 203 686 788</b> | <b>99,40 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b>       |            |          | <b>91 017 502</b>     | <b>0,60 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                             |            |          | <b>15 294 704 290</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza 100

Avanza 100 är en fondandelsfond och har som mål att uppnå en god avkastning på lång sikt genom att placera mellan 80 och 100 procent av fondförmögenheten i aktierelaterade tillgångar. De underliggande fonderna ska ge en bred exponering mot de svenska och globalaktiemarknaderna.

Avanza 100 är en specialfond vilket innebär att fonden har friare placeringsregler än traditionella värdepappersfonder.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 16,1 procent, vilket var sämre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 17,8 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 711,8 miljoner kronor till 882,2 miljoner kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Aktieandelen i Avanza 100 är normalt exponerad till nära 100 procent och har så varit under 2023. Allokeringen har bestått av en global aktieexponering om 85 procent, varv ca 15 procent i tillväxtmarknader, som kombinerats med en vikt om 15 procent i svenska aktier.

Fonden har fortsatt varit i det närmaste fullinvesterad i aktiefonder med exponering mot svenska-, globala- och tillväxtmarknadsaktier.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

Lägsta hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under räkenskapsåret 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden är exponerad mot likviditets, aktiekurs, kredit, ränte- och valutarisker eftersom placeringar av kapitalet sker

## Fondfakta

|  |                                  |
|--|----------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2012-10-25                       |
| Andelsvärde  | 355,19                           |
| Fondförmögenhet, tkr   | 882 165                          |
| Utveckling, %  | 16,06                            |
| Utv. jämförelseindex, %  | 17,84                            |
| Kursnotering   | Daglig                           |
| Inträdesavgift   | Ingen                            |
| Utträdesavgift   | Ingen                            |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,59                             |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,49                             |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                             |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                             |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,03                             |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                  |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning    |
| Förvaltare   | Peter Stengård, Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-5875                      |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                  |

| Fondens 5 största innehav       | Exponering, tkr | % av fond |
|---------------------------------|-----------------|-----------|
| Swedbank Robur Access Global    | 160 085         | 18,15 %   |
| Amundi Index Msci World SRI     | 158 087         | 17,92 %   |
| Handelsbanken Global Index Crit | 155 758         | 17,66 %   |
| Storebrand Aktiefond Global A   | 150 122         | 17,02 %   |
| Avanza Sverige                  | 69 802          | 7,91 %    |

på den internationella aktiemarknaden samt räntemarknaden. Aktiemarknaden är förknippad med hög risk, men också med möjligheten till hög avkastning. Genom att placeringarna i fonden sprids mellan flertalet olika fonder på en global marknad, så kallad diversifiering, minskas aktiekursrisken i fonden. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fondens diversifiering mellan olika fondinnehav medför också att likviditetsrisken begränsas. Innehaven kan vara i både svensk och utländsk valuta, därav valutarisk i fonden. Fonden har enligt fondbestämmelserna ej tillstånd att handla med derivatinstrument.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Avanza 100 jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 85 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK och 15 procent Morningstar Sweden NR SEK. Det sammansatta indexet är relevant då det bäst speglar Avanza 100s långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångsslag.

Avanza 100 är en fondandelsfond där förvaltaren väljer vilka fonder som Avanza 100 placerar i. Avanza 100:s avkastning kommer över tid att avvika från jämförelseindexet och storleken på den aktiva risken kan variera från år till år.

Avanza 100 har avvikit från jämförelseindex i förväntad omfattning. Sett till den senaste 24-månadersperioden, som redovisas under 2023, förklaras den minskade aktiva risken av att förvaltaren har i större omfattning investerat i enlighet med jämförelseindex under perioden. Avanza 100s aktiva risk bedöms ligga inom det spann som är förväntat.

För information om den aktiva risken se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

### Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året. Fonden ändrade i samband med det sina fondbestämmelser och fonden gavs möjlighet att investera i derivat.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>    |
|---|----------------|----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 118 245        | -90 025        |
| Övriga finansiella intäkter               | 1 741          | 1 510          |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>119 986</b> | <b>-88 515</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>    |
| Förvaltningskostnader                     | -3 994         | -3 554         |
| Övriga finansiella kostnader              | -5             | -16            |
| Övriga kostnader                          | -              | -5             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-3 999</b>  | <b>-3 575</b>  |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>115 986</b> | <b>-92 090</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 877 952           | 708 925           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>877 952</b>    | <b>708 925</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 4 855             | 3 368             |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 414               | 364               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>883 222</b>    | <b>712 656</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 1 057             | 892               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>1 057</b>      | <b>892</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>882 165</b>    | <b>711 765</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>    | <b>2022</b>    |
|--|----------------|----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                |                |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                |                |
| Realisationsvinster                          | 5 673          | 9 877          |
| Realisationsförluster                        | -379           | -347           |
| Orealiserade vinster/förluster               | 112 951        | -99 555        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>118 245</b> | <b>-90 025</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 711 765           | 788 974           |
| Andelsutgivning                           | 144 716           | 130 735           |
| Andelsinlösen                             | -90 303           | -115 855          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 115 986           | -92 090           |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>882 165</b>    | <b>711 765</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> | <b>2021-12-31</b> | <b>2020-12-31</b> | <b>2019-12-31</b> |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 882 165           | 711 765           | 788 974           | 543 752           | 559 798           |
| Andelsvärde              | 355,19            | 306,04            | 345,84            | 267,63            | 255,79            |
| Antal utestående andelar | 2 483 643         | 2 325 707         | 2 281 334         | 2 031 731         | 2 188 525         |
| Utdelning kr/andel       | -                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| Totalavkastning, %       | 16,06             | -11,51            | 29,22             | 4,63              | 31,63             |
| Jämförelseindex, %       | 17,84             | -8,49             | 30,66             | 3,57              | -                 |
| Aktiv risk (2 år), %     | 1,88              | 2,33              | 2,99              | -                 | -                 |
|                          | <b>2018-12-31</b> | <b>2017-12-31</b> | <b>2016-12-31</b> | <b>2015-12-31</b> | <b>2014-12-31</b> |
| Fondförmögenhet, tkr     | 379 094           | 366 599           | 238 816           | 155 721           | 106 580           |
| Andelsvärde              | 194,32            | 200,35            | 177,26            | 154,18            | 148,45            |
| Antal utestående andelar | 1 950 847         | 1 829 773         | 1 347 266         | 1 010 018         | 717 955           |
| Utdelning kr/andel       | -                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| Totalavkastning, %       | -3,01             | 13,03             | 14,97             | 3,86              | 22,99             |
| Jämförelseindex, %       | -                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| Aktiv risk (2 år), %     | -                 | -                 | -                 | -                 | -                 |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 3,30                    | 1 367,06      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 53,95                   | 11 606,00     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,03  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,49  |
| Avgifter, % 1)                         | 0,59  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 5,16  |
| Transaktionskostnader, % 2)            | 0,01  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 13,49 |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 13,71 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 1,34  |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 12,82 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.



## Finansiella instrument

| Värdepapper  | Antal   | Kurs   | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|--|---------|--------|--------------------|----------------------|
| <b>Övriga finansiella instrument</b>               |         |        |                    | <b>99,52 %</b>       |
| <b>Fondandelar</b>                                 |         |        |                    |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                                 |         |        |                    |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI             | 366 306 | 105,17 | 38 524 378         | 4,37 %               |
| Amundi Index Msci World SRI                        | 981 665 | 161,04 | 158 087 396        | 17,92 %              |
| Avanza Sverige                                     | 843 632 | 82,74  | 69 802 095         | 7,91 %               |
| East Capital Global Emerging Markets Sustainable C | 405 931 | 96,42  | 39 138 584         | 4,44 %               |
| Handelsbanken Global Index Crit                    | 336 142 | 463,37 | 155 758 035        | 17,66 %              |
| Storebrand Aktiefond Global A                      | 662 909 | 226,46 | 150 121 897        | 17,02 %              |
| Storebrand Aktiefond Sverige                       | 71 329  | 480,41 | 34 266 855         | 3,88 %               |
| Swedbank Robur Access Global                       | 605 787 | 264,26 | 160 085 159        | 18,15 %              |
| Swedbank Robur Access Sverige                      | 122 039 | 281,42 | 34 344 321         | 3,89 %               |
| Öhman Etisk Emerging Markets                       | 169 506 | 223,14 | 37 823 573         | 4,29 %               |
|  |         |        | <b>877 952 294</b> | <b>99,52 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                           |         |        | <b>877 952 294</b> | <b>99,52 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>               |         |        | <b>877 952 294</b> | <b>99,52 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b>       |         |        | <b>4 212 384</b>   | <b>0,48 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                             |         |        | <b>882 164 678</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Auto 1

Avanza Auto 1 är en specialfond (fondandelsfond). Aktieexponeringen i Avanza Auto 1 ligger normalt mellan 10 och 40 procent. Nuvarande allokering uppgår till drygt 22 procent. Autofondernas strategi är att genom modern portföljteori uppnå en optimerad tillgångssammansättning med syftet att långsiktigt generera en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning. Det sistnämnda med hänsyn tagen till fondens risknivå och övriga restriktioner såsom låga avgifter och hållbara investeringar.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 8,6 procent, vilket var bättre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 8,3 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 364,7 miljoner kronor till 396,2 miljoner kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Avanza Auto 1 hade ett bra år i både absoluta termer och relativa där USA stått för den enskilt största bidragsgivaren till avkastningen. Sett till räntedelen av fonden har det varit gynnsamt med en längre duration och specifikt i kreditsegmentet.

Allokeringsstrategin för Avanza Auto-fonderna kommer att fortsätta utvecklas i riktning mot en ökad diversifiering med målsättningen att över tid uppnå en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.  
Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.  
Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den

## Fondfakta

|  |                                       |
|--|---------------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2017-09-25                            |
| Andelsvärde  | 114,00                                |
| Fondförmögenhet, tkr   | 396 222                               |
| Utveckling, %  | 8,57                                  |
| Utv. jämförelseindex, %  | 8,26                                  |
| Kursnotering   | Daglig                                |
| Inträdesavgift   | Ingen                                 |
| Utträdesavgift   | Ingen                                 |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,32                                  |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,20                                  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                                  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                                  |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,46                                  |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                       |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning         |
| Förvaltare   | Anders Brommesson<br>Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-8945                           |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                       |

| Fondens 5 största innehav    | Exponering, tkr | % av fond |
|------------------------------|-----------------|-----------|
| AMF Räntefond Mix            | 69 751          | 17,60 %   |
| Amundi IS Glb AGG SRI        | 67 404          | 17,01 %   |
| Öhman Obligationsfond SEK A  | 41 712          | 10,53 %   |
| Storebrand Obligation A      | 41 196          | 10,40 %   |
| Captor Aster Global Credit A | 26 634          | 6,72 %    |

aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risk som fonden är exponerad mot är den marknadsrisk som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk, sådan risk är mest påtaglig i innehav med låg omsättning. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Avanza Auto 1s jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 21,25 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK, 37,5 procent NASDAQ OMRX Total Markets TR SEK, 37,5 procent BBgBarc Global Aggregate TR Hdg SEK och 3,75 procent Morningstar Sweden NR. Det sammansatta indexet är relevant då det speglar Avanza Auto 1s långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångsslag.

Avanza Auto 1 är en fondandelsfond där förvaltningen utgår från en modell. Avanza Auto 1s avkastning kommer över tid att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken blir därmed olika år från år.

Avanza Auto 1 investerar en stor del i räntefonder, och genom en lägre aktiv risk i sina ränteplaceringar i förhållande till jämförelseindex kan fonden uppvisa en lägre aktiv risk jämfört med fondandelsfonder som inte placerar i räntefonder, exempelvis Avanza Auto 6.

Bedömningen är Avanza Auto 1s aktiva risk bedöms ligga inom det spann som den bör ligga inom. För information om aktivitetsgraden se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

### Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|---|---------------|----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 31 154        | -38 101        |
| Övriga finansiella intäkter               | 803           | 596            |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>31 957</b> | <b>-37 505</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
| Förvaltningskostnader                     | -750          | -757           |
| Övriga finansiella kostnader              | -14           | -34            |
| Övriga kostnader                          | -             | -18            |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-764</b>   | <b>-809</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>31 193</b> | <b>-38 314</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 392 759           | 361 455           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>392 759</b>    | <b>361 455</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 3 506             | 3 289             |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 150               | 162               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>396 414</b>    | <b>364 907</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 192               | 189               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>192</b>        | <b>189</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>396 222</b>    | <b>364 718</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|--|---------------|----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |               |                |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |               |                |
| Realisationsvinster                          | 4 381         | 6 175          |
| Realisationsförluster                        | -9 515        | -5 738         |
| Orealiserade vinster/förluster               | 36 288        | -38 537        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>31 154</b> | <b>-38 101</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 364 718           | 392 454           |
| Andelsutgivning                           | 110 151           | 148 426           |
| Andelsinlösen                             | -109 839          | -137 849          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 31 193            | -38 314           |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>396 222</b>    | <b>364 718</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 396 222    | 364 718    | 392 454    | 283 254    | 288 981    |
| Andelsvärde              | 114,00     | 105,00     | 115,90     | 108,88     | 107,35     |
| Antal utestående andelar | 3 475 736  | 3 473 436  | 3 386 279  | 2 601 463  | 2 691 923  |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 8,57       | -9,40      | 6,45       | 1,43       | 6,35       |
| Jämförelseindex, %       | 8,26       | -9,67      | 6,54       | 1,93       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 0,98       | 0,89       | 1,26       | -          | -          |
|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 236 625    | 52 177     |            |            |            |
| Andelsvärde              | 100,94     | 101,49     |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 2 344 133  | 514 153    |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | -0,54      | 1,49       |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 1,31                    | 1 362,62      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 20,65                   | 10 857,14     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,46  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,20  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,32  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 14,25 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 7,34  |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 7,03  |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | -0,82 |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 2,46  |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicy vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicy är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvalta fonder riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |         |           |                    | 99,13 %              |
|--|---------|-----------|--------------------|----------------------|
| Värdepapper                                  | Antal   | Kurs      | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                           |         |           |                    |                      |
| <b>Räntefonder</b>                           |         |           |                    |                      |
| AMF Räntefond Mix                            | 618 633 | 112,75    | 69 750 873         | 17,60 %              |
| Amundi IS Glb AGG SRI                        | 6 544   | 10 299,51 | 67 404 010         | 17,01 %              |
| Captor Aster Global Credit A                 | 96 331  | 276,49    | 26 634 479         | 6,72 %               |
| Captor Aster Global Credit Short Term A      | 74 206  | 325,20    | 24 131 512         | 6,09 %               |
| Captor Iris Bond A                           | 81 666  | 258,95    | 21 147 319         | 5,34 %               |
| Storebrand Global Företagsobligations Plus A | 118 783 | 101,34    | 12 037 739         | 3,04 %               |
| Storebrand Obligation A                      | 282 187 | 145,99    | 41 196 034         | 10,40 %              |
| Öhman Obligationsfond SEK A                  | 428 560 | 97,33     | 41 711 709         | 10,53 %              |
|  |         |           | <b>304 013 676</b> | <b>76,73 %</b>       |
| <b>Aktiefonder</b>                           |         |           |                    |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI       | 60 523  | 105,17    | 6 365 174          | 1,61 %               |
| Amundi Index Msci Europe SRI                 | 32 699  | 139,13    | 4 549 448          | 1,15 %               |
| Amundi Index Msci USA SRI                    | 81 339  | 179,14    | 14 571 029         | 3,68 %               |
| Avanza Sverige                               | 83 005  | 82,74     | 6 867 862          | 1,73 %               |
| FE Småbolag Sverige                          | 43 279  | 110,10    | 4 765 046          | 1,20 %               |
| Humble Småbolagsfond A                       | 7 454   | 650,76    | 4 850 826          | 1,22 %               |
| Storebrand Aktiefond Europa                  | 17 655  | 213,05    | 3 761 532          | 0,95 %               |
| Storebrand Aktiefond USA                     | 29 623  | 484,83    | 14 362 383         | 3,62 %               |
| Swedbank Robur Access Europa                 | 11 325  | 211,15    | 2 391 366          | 0,60 %               |
| Swedbank Robur Access Japan                  | 25 221  | 183,53    | 4 628 800          | 1,17 %               |
| Swedbank Robur Access USA                    | 26 498  | 571,33    | 15 139 123         | 3,82 %               |
| Öhman Etisk Emerging Markets                 | 29 095  | 223,14    | 6 492 240          | 1,64 %               |
|  |         |           | <b>88 744 827</b>  | <b>22,40 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |         |           | <b>392 758 503</b> | <b>99,13 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |         |           | <b>392 758 503</b> | <b>99,13 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |         |           | <b>3 463 471</b>   | <b>0,87 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |         |           | <b>396 221 974</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Auto 2

Avanza Auto 2 är en specialfond (fondandelsfond). Aktieexponeringen i Avanza Auto 2 ligger normalt mellan 25 och 55 procent. Nuvarande allokering uppgår till drygt 40 procent. Autofondernas strategi är att genom modern portföljteori uppnå en optimerad tillgångssammansättning med syftet att långsiktigt generera en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning. Det sistnämnda med hänsyn tagen till fondens risknivå och övriga restriktioner såsom låga avgifter och hållbara investeringar.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 9,8 procent, vilket var sämre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 10,2 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 641,1 miljoner kronor till 712,7 miljoner kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Avanza Auto 2 hade ett bra år i absoluta termer där USA stått för den enskilt största bidragsgivaren till avkastningen. Relativt sitt jämförelseindex har fonden haft en undervikt mot USA vilket då självklart förklarar varför fonden inte presterat bättre. Exponeringen mot svenska långa statsobligationer har haft en fin utveckling under året och är det innehav som bidragit näst mest till fondens avkastning, följt av globala statsobligationer.

Allokeringsstrategin för Avanza Auto-fonderna kommer att fortsätta utvecklas i riktning mot en ökad diversifiering med målsättningen att över tid uppnå en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.  
Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.  
Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den

## Fondfakta

|  |                                       |
|--|---------------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2017-09-25                            |
| Andelsvärde  | 126,46                                |
| Fondförmögenhet, tkr   | 712 657                               |
| Utveckling, %  | 9,81                                  |
| Utv. jämförelseindex, %  | 10,15                                 |
| Kursnotering   | Daglig                                |
| Inträdesavgift   | Ingen                                 |
| Utträdesavgift   | Ingen                                 |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,32                                  |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,20                                  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                                  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                                  |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,35                                  |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                       |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning         |
| Förvaltare   | Anders Brommesson<br>Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-8952                           |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                       |

| Fondens 5 största innehav | Exponering, tkr | % av fond |
|---------------------------|-----------------|-----------|
| Amundi IS Glb AGG SRI     | 142 489         | 19,99 %   |
| AMF Räntefond Mix         | 140 643         | 19,74 %   |
| Captor Iris Bond A        | 119 690         | 16,79 %   |
| Amundi Index Msci USA SRI | 41 809          | 5,87 %    |
| Swedbank Robur Access USA | 41 222          | 5,78 %    |

aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risk som fonden är exponerad mot är den marknadsrisk som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk då somliga av fondens innehav kan vara svåra att likvidera. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

## Aktivitetsgrad

Avanza Auto 2 jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 34 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK, 30 procent NASDAQ OMRX Total Markets TR SEK, 30 procent, BBgBarc Global Aggregate TR Hdg SEK och 6 procent Morningstar Sweden NR. Det sammansatta indexet är relevant då det bäst speglar Avanza Auto 2 långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångsslag.

Avanza Auto 2 är en fondandelsfond där förvaltningen utgår från en modell. Avanza Auto 2s avkastning kommer över tid att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken blir därmed olika år från år.

Avanza Auto 2 investerar en stor del i räntefonder, och genom en lägre aktiv risk i sina ränteplaceringar i förhållande till jämförelseindex kan Avanza Auto 2 uppvisa en lägre aktiv risk jämfört med fondandelsfonder och inte placerar i räntefonder, exempelvis Avanza Auto 6.

Avanza Auto 2 har avvikit från sitt jämförelseindex i förväntad omfattning. Bedömningen är att Avanza Auto 2s aktiva risk ligger inom det spann som den bör ligga inom. För information om aktivitetsgraden se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

## Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|---|---------------|----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 63 714        | -84 297        |
| Övriga finansiella intäkter               | 1 363         | 1 201          |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>65 077</b> | <b>-83 096</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
| Förvaltningskostnader                     | -1 357        | -1 312         |
| Övriga finansiella kostnader              | -21           | -38            |
| Övriga kostnader                          | -             | -14            |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-1 378</b> | <b>-1 365</b>  |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>63 700</b> | <b>-84 461</b> |



## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 703 614           | 633 024           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>703 614</b>    | <b>633 024</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 9 104             | 8 126             |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 289               | 291               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>713 006</b>    | <b>641 441</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 349               | 328               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>349</b>        | <b>328</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>712 657</b>    | <b>641 113</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|--|---------------|----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |               |                |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |               |                |
| Realisationsvinster                          | 14 259        | 14 734         |
| Realisationsförluster                        | -19 893       | -10 071        |
| Orealiserade vinster/förluster               | 69 348        | -88 960        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>63 714</b> | <b>-84 297</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 641 113           | 735 279           |
| Andelsutgivning                           | 226 516           | 238 120           |
| Andelsinlösen                             | -218 672          | -247 825          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 63 700            | -84 461           |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>712 657</b>    | <b>641 113</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 712 657    | 641 113    | 735 279    | 510 102    | 490 154    |
| Andelsvärde              | 126,46     | 115,16     | 130,40     | 117,82     | 115,71     |
| Antal utestående andelar | 5 635 372  | 5 566 995  | 5 638 607  | 4 329 514  | 4 236 206  |
| Utdelning kr/andel       | 0,00       | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 9,81       | -11,69     | 10,68      | 1,82       | 12,96      |
| Jämförelseindex, %       | 10,15      | -9,38      | 11,10      | 1,84       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 1,48       | 1,30       | 1,36       | -          | -          |
|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 322 859    | 158 540    |            |            |            |
| Andelsvärde              | 102,43     | 103,42     |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 3 152 066  | 1 532 986  |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | -0,96      | 3,42       |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 1,32                    | 1 363,75      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 20,87                   | 10 981,24     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,35  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,20  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,32  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 21,18 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 9,25  |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 8,19  |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | -1,52 |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 4,31  |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyen vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyen är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvalta fonder riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |           |           |                    | 98,73 %              |
|--|-----------|-----------|--------------------|----------------------|
| Värdepapper                                  | Antal     | Kurs      | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                           |           |           |                    |                      |
| <b>Räntefonder</b>                           |           |           |                    |                      |
| AMF Räntefond Mix                            | 1 247 391 | 112,75    | 140 643 288        | 19,74 %              |
| Amundi IS Glb AGG SRI                        | 13 835    | 10 299,51 | 142 489 467        | 19,99 %              |
| Captor Iris Bond A                           | 462 213   | 258,95    | 119 690 076        | 16,79 %              |
| Storebrand Global Företagsobligations Plus A | 279       | 101,34    | 28 310             | 0,00 %               |
| Storebrand Obligation A                      | 65 508    | 145,99    | 9 563 414          | 1,34 %               |
| Öhman Obligationsfond SEK A                  | 103 671   | 97,33     | 10 090 287         | 1,42 %               |
|  |           |           | <b>422 504 842</b> | <b>59,29 %</b>       |
| <b>Aktiefonder</b>                           |           |           |                    |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI       | 195 797   | 105,17    | 20 591 932         | 2,89 %               |
| Amundi Index Msci Europe SRI                 | 67 954    | 139,13    | 9 454 479          | 1,33 %               |
| Amundi Index Msci USA SRI                    | 233 386   | 179,14    | 41 808 771         | 5,87 %               |
| Avanza Sverige                               | 178 983   | 82,74     | 14 809 079         | 2,08 %               |
| FE Småbolag Sverige                          | 151 575   | 110,10    | 16 688 538         | 2,34 %               |
| Humle Småbolagsfond A                        | 26 373    | 650,76    | 17 162 378         | 2,41 %               |
| Storebrand Aktiefond Europa                  | 46 666    | 213,05    | 9 942 374          | 1,40 %               |
| Storebrand Aktiefond USA                     | 84 851    | 484,83    | 41 138 338         | 5,77 %               |
| Swedbank Robur Access Europa                 | 47 329    | 211,15    | 9 993 596          | 1,40 %               |
| Swedbank Robur Access Japan                  | 139 509   | 183,53    | 25 604 074         | 3,59 %               |
| Swedbank Robur Access USA                    | 72 151    | 571,33    | 41 221 746         | 5,78 %               |
| Öhman Etisk Emerging Markets                 | 91 696    | 223,14    | 20 460 947         | 2,87 %               |
| Öhman Etisk Index Pacific                    | 34 981    | 349,69    | 12 232 535         | 1,72 %               |
|  |           |           | <b>281 108 787</b> | <b>39,45 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |           |           | <b>703 613 629</b> | <b>98,73 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |           |           | <b>703 613 629</b> | <b>98,73 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |           |           | <b>9 043 161</b>   | <b>1,27 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |           |           | <b>712 656 790</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Auto 3

Avanza Auto 3 är en specialfond (fondandelsfond). Aktieexponeringen i Avanza Auto 3 ligger normalt mellan 40 och 70 procent. Nuvarande allokering uppgår till drygt 51 procent. Autofondernas strategi är att genom modern portföljteori uppnå en optimerad tillgångssammansättning med syftet att långsiktigt generera en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning. Det sistnämnda med hänsyn tagen till fondens risknivå och övriga restriktioner såsom låga avgifter och hållbara investeringar.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 13,1 procent, vilket var bättre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 12,1 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 813,0 miljoner kronor till 966,8 miljoner kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Avanza Auto 3 hade ett bra år i både absoluta termer och relativa där USA stått för den enskilt största bidragsgivaren till avkastningen. Fondens övervikt mot Japan har även gynnat fonden i relativa termer. Sett till räntedelen av fonden har längre duration och kreditexponering varit positivt under året. Fonden har under året minskat sin exponering mot EM och Pacific samt ökat sin exponering mot Japan, något som fallit ut väl.

Allokeringsstrategin för Avanza Auto-fonderna kommer att fortsätta utvecklas i riktning mot en ökad diversifiering med målsättningen att över tid uppnå en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Fondfakta

|  |                                       |
|--|---------------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2017-09-25                            |
| Andelsvärde  | 140,00                                |
| Fondförmögenhet, tkr   | 966 825                               |
| Utveckling, %  | 13,10                                 |
| Utv. jämförelseindex, %  | 12,06                                 |
| Kursnotering   | Daglig                                |
| Inträdesavgift   | Ingen                                 |
| Utträdesavgift   | Ingen                                 |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,34                                  |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,20                                  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                                  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                                  |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,35                                  |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                       |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning         |
| Förvaltare   | Anders Brommesson<br>Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-8960                           |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                       |

| Fondens 5 största innehav        | Exponering, tkr | % av fond |
|----------------------------------|-----------------|-----------|
| Captor Iris Bond A               | 201 887         | 20,88 %   |
| Captor Aster Global Credit A     | 101 924         | 10,54 %   |
| Captor Aster Global Credit Short |                 |           |
| Term A                           | 92 448          | 9,56 %    |
| Storebrand Aktiefond USA         | 76 013          | 7,86 %    |
| Amundi Index Msci USA SRI        | 74 829          | 7,74 %    |

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risk som fonden är exponerad mot är den marknadsrisk som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk då somliga av fondens innehav kan vara svåra att likvidera. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

## Aktivitetsgrad

Avanza Auto 3s jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 46,75 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK, 22,5 procent NASDAQ OMRX Total Markets TR SEK, 22,5 procent BBgBarc Global Aggregate TR Hdg SEK och 8,25 procent Morningstar Sweden NR. Det sammansatta indexet är relevant då det bäst speglar Avanza Auto 3s långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångsslag.

Avanza Auto 3 är en fondandelsfond där förvaltningen utgår från en modell. Avanza Auto 3s avkastning kommer över tid att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken blir därmed olika år från år.

Avanza Auto 3 investerar en stor del i räntefonder, och genom en lägre aktiv risk i sina ränteplaceringar i förhållande till jämförelseindex kan fonden uppvisa en lägre aktiv risk jämfört med fondandelsfonder och inte placerar i räntefonder, exempelvis Avanza Auto 6.

Sett till den senaste 24-månadersperioden, som redovisas under 2023, minskade den aktiva risken något jämfört med tidigare år. Det kan förklaras av att förvaltaren i större omfattning har investerat i enlighet med jämförelseindex.

Bedömningen är Avanza Auto 3s aktiva risk bedöms ligga inom det spann som den bör ligga inom. För information om aktivitetsgraden se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

## Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|---|----------------|-----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 108 014        | -108 237        |
| Övriga finansiella intäkter               | 2 951          | 1 861           |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>110 965</b> | <b>-106 376</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -1 766         | -1 615          |
| Övriga finansiella kostnader              | -23            | -55             |
| Övriga kostnader                          | -              | -19             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-1 789</b>  | <b>-1 690</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>109 176</b> | <b>-108 066</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 955 019           | 790 927           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>955 019</b>    | <b>790 927</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 11 619            | 21 953            |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 647               | 548               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>967 285</b>    | <b>813 428</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 460               | 416               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>460</b>        | <b>416</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>966 825</b>    | <b>813 013</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|--|----------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                |                 |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                |                 |
| Realisationsvinster                          | 25 399         | 26 659          |
| Realisationsförluster                        | -8 225         | -28 286         |
| Orealiserade vinster/förluster               | 90 840         | -106 609        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>108 014</b> | <b>-108 237</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 813 013           | 886 817           |
| Andelsutgivning                           | 316 134           | 336 740           |
| Andelsinlösen                             | -271 497          | -302 479          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 109 176           | -108 066          |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>966 825</b>    | <b>813 013</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 966 825    | 813 013    | 886 817    | 584 071    | 578 839    |
| Andelsvärde              | 140,00     | 123,78     | 140,78     | 122,70     | 119,96     |
| Antal utestående andelar | 6 905 829  | 6 568 176  | 6 299 099  | 4 755 103  | 4 825 303  |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 13,10      | -12,08     | 14,61      | 2,40       | 16,27      |
| Jämförelseindex, %       | 12,06      | -9,10      | 15,82      | 1,67       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 2,35       | 2,75       | 2,87       | -          | -          |
|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 402 107    | 232 772    |            |            |            |
| Andelsvärde              | 103,17     | 104,38     |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 3 897 437  | 2 230 187  |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | -1,16      | 4,38       |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 1,32                    | 1 383,49      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 21,17                   | 11 310,39     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,35  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,20  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,34  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 22,83 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 11,15 |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 9,47  |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | -0,28 |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 6,30  |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyen vidtog under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyen är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaldade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |         |           |                    | 98,78 %              |
|--|---------|-----------|--------------------|----------------------|
| Värdepapper                                  | Antal   | Kurs      | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                           |         |           |                    |                      |
| <b>Räntefonder</b>                           |         |           |                    |                      |
| AMF Räntefond Mix                            | 88 324  | 112,75    | 9 958 533          | 1,03 %               |
| Amundi IS Glb AGG SRI                        | 948     | 10 299,51 | 9 764 862          | 1,01 %               |
| Captor Aster Global Credit A                 | 368 636 | 276,49    | 101 923 597        | 10,54 %              |
| Captor Aster Global Credit Short Term A      | 284 283 | 325,20    | 92 447 668         | 9,56 %               |
| Captor Iris Bond A                           | 779 638 | 258,95    | 201 887 199        | 20,88 %              |
| Storebrand Global Företagsobligations Plus A | 464 000 | 101,34    | 47 022 895         | 4,86 %               |
|  |         |           | <b>463 004 755</b> | <b>47,89 %</b>       |
| <b>Aktiefonder</b>                           |         |           |                    |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI       | 226 215 | 105,17    | 23 791 035         | 2,46 %               |
| Amundi Index Msci Europe SRI                 | 126 237 | 139,13    | 17 563 315         | 1,82 %               |
| Amundi Index Msci USA SRI                    | 417 715 | 179,14    | 74 829 432         | 7,74 %               |
| Avanza Sverige                               | 434 768 | 82,74     | 35 972 667         | 3,72 %               |
| FE Småbolag Sverige                          | 359 266 | 110,10    | 39 555 361         | 4,09 %               |
| Humle Småbolagsfond A                        | 64 569  | 650,76    | 42 018 968         | 4,35 %               |
| Storebrand Aktiefond Europa                  | 82 413  | 213,05    | 17 558 491         | 1,82 %               |
| Storebrand Aktiefond USA                     | 156 782 | 484,83    | 76 012 803         | 7,86 %               |
| Swedbank Robur Access Europa                 | 88 033  | 211,15    | 18 588 232         | 1,92 %               |
| Swedbank Robur Access Japan                  | 252 707 | 183,53    | 46 379 381         | 4,80 %               |
| Swedbank Robur Access USA                    | 130 354 | 571,33    | 74 474 924         | 7,70 %               |
| Öhman Etisk Emerging Markets                 | 113 246 | 223,14    | 25 269 761         | 2,61 %               |
|  |         |           | <b>492 014 370</b> | <b>50,89 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |         |           | <b>955 019 125</b> | <b>98,78 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |         |           | <b>955 019 125</b> | <b>98,78 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |         |           | <b>11 806 270</b>  | <b>1,22 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |         |           | <b>966 825 395</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.



# Avanza Auto 4

Avanza Auto 4 är en specialfond (fondandelsfond). Aktieexponeringen i Avanza Auto 4 ligger normalt mellan 55 och 85 procent. Nuvarande allokering uppgår till drygt 68 procent. Autofondernas strategi är att genom modern portföljteori uppnå en optimerad tillgångssammansättning med syftet att långsiktigt generera en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning. Det sistnämnda med hänsyn tagen till fondens risknivå och övriga restriktioner såsom låga avgifter och hållbara investeringar.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 13,6 procent, vilket var mindre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 14,0 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 951,9 miljoner kronor till 1,2 miljarder kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Avanza Auto 4 hade ett bra år i absoluta termer där USA stått för den enskilt största bidragsgivaren till avkastningen. Relativt sitt jämförelseindex har fonden haft en undervikt mot USA vilket då självklart förklarar varför fonden inte presterat bättre. Exponeringen mot svenska långa statsobligationer har haft en fin utveckling under året och är det innehav som bidragit näst mest till fondens avkastning. Fonden har under året minskat sin exponering mot EM och Pacific samt ökat sin exponering mot Japan, något som fallit ut väl.

Allokeringsstrategin för Avanza Auto-fonderna kommer att fortsätta utvecklas i riktning mot en ökad diversifiering med målsättningen att över tid uppnå en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Fondfakta

|  |                                       |
|--|---------------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2017-09-25                            |
| Andelsvärde  | 154,50                                |
| Fondförmögenhet, tkr   | 1 203 790                             |
| Utveckling, %  | 13,62                                 |
| Utv. jämförelseindex, %  | 13,97                                 |
| Kursnotering   | Daglig                                |
| Inträdesavgift   | Ingen                                 |
| Utträdesavgift   | Ingen                                 |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,34                                  |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,20                                  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                                  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                                  |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,21                                  |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                       |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning         |
| Förvaltare   | Anders Brommesson<br>Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-8978                           |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                       |

| Fondens 5 största innehav   | Exponering, tkr | % av fond |
|-----------------------------|-----------------|-----------|
| Captor Iris Bond A          | 252 016         | 20,94 %   |
| Storebrand Aktiefond USA    | 120 265         | 9,99 %    |
| Swedbank Robur Access USA   | 119 989         | 9,97 %    |
| Amundi Index Msci USA SRI   | 118 492         | 9,84 %    |
| Swedbank Robur Access Japan | 72 986          | 6,06 %    |

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risk som fonden är exponerad mot är den marknadsrisk som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk då somliga av fondens innehav kan vara svåra att likvidera. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

## Aktivitetsgrad

Avanza Auto 4s jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 59,5 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK, 15 procent NASDAQ OMRX Total Markets TR SEK, 15 procent BBGBarc Global Aggregate TR Hdg SEK och 10,5 procent Morningstar Sweden NR. Det sammansatta indexet är relevant då det speglar Avanza Auto 4s långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångsslag.

Avanza Auto 4 är en fondandelsfond där förvaltningen utgår från en modell. Avanza Auto 4s avkastning kommer över tid att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken blir därmed olika år från år.

Avanza Auto 4 investerar en del av sitt kapital i räntefonder, och genom en lägre aktiv risk i sina ränteplaceringar i förhållande till jämförelseindex kan fonden uppvisa en lägre aktiv risk jämfört med fondandelsfonder och inte placerar i räntefonder, exempelvis Avanza Auto 6.

Sett till den senaste 24-månadersperioden, som redovisas under 2023, minskade den aktiva risken något jämfört med tidigare år. Det kan förklaras av att förvaltaren i större omfattning har investerat i enlighet med jämförelseindex.

Bedömningen är Avanza Auto 4s aktiva risk ligger inom det spann som den bör ligga. För information om aktiv risk se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

## Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|---|----------------|-----------------|
| Värdoförändring på fondandelar (Not 1)    | 135 641        | -120 527        |
| Övriga finansiella intäkter               | 3 693          | 2 326           |
| <b>Summa intäkter och värdoförändring</b> | <b>139 334</b> | <b>-118 201</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -2 192         | -1 865          |
| Övriga finansiella kostnader              | -22            | -55             |
| Övriga kostnader                          | -              | -18             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-2 214</b>  | <b>-1 938</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>137 120</b> | <b>-120 139</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 1 191 294         | 941 542           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>1 191 294</b>  | <b>941 542</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 12 259            | 10 127            |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 814               | 688               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>1 204 368</b>  | <b>952 356</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 577               | 487               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>577</b>        | <b>487</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>1 203 790</b>  | <b>951 869</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|--|----------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                |                 |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                |                 |
| Realisationsvinster                          | 31 629         | 30 734          |
| Realisationsförluster                        | -539           | -24 970         |
| Orealiserade vinster/förluster               | 104 551        | -126 291        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>135 641</b> | <b>-120 527</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 951 869           | 967 204           |
| Andelsutgivning                           | 270 671           | 270 799           |
| Andelsinlösen                             | -155 869          | -165 995          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 137 120           | -120 139          |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>1 203 790</b>  | <b>951 869</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 1 203 790  | 951 870    | 967 204    | 690 910    | 641 309    |
| Andelsvärde              | 154,50     | 135,98     | 154,23     | 128,53     | 124,71     |
| Antal utestående andelar | 7 791 686  | 7 000 210  | 6 271 084  | 5 368 509  | 5 142 554  |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 13,62      | -11,83     | 19,84      | 3,20       | 20,34      |
| Jämförelseindex, %       | 13,97      | -8,86      | 20,72      | 1,41       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 2,25       | 2,41       | 2,99       | -          | -          |
|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 429 482    | 53         |            |            |            |
| Andelsvärde              | 103,64     | 105,31     |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 4 144 186  | 501 078    |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | -1,60      | 5,31       |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 1,33                    | 1 376,51      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 21,39                   | 11 361,96     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,21  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,20  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,34  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 22,35 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 12,21 |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 10,84 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 0,09  |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 8,31  |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyen vidtog under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyen är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltningsfonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningsystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |         |        |                      | 98,96 %              |
|--|---------|--------|----------------------|----------------------|
| Värdepapper                                  | Antal   | Kurs   | Marknadsvärde        | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                           |         |        |                      |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                           |         |        |                      |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI       | 503 479 | 105,17 | 52 950 874           | 4,40 %               |
| Amundi Index Msci Europe SRI                 | 211 433 | 139,13 | 29 416 738           | 2,44 %               |
| Amundi Index Msci USA SRI                    | 661 450 | 179,14 | 118 492 137          | 9,84 %               |
| Avanza Sverige                               | 671 783 | 82,74  | 55 583 365           | 4,62 %               |
| FE Småbolag Sverige                          | 574 748 | 110,10 | 63 280 076           | 5,26 %               |
| Humle Småbolagsfond A                        | 103 915 | 650,76 | 67 623 790           | 5,62 %               |
| Storebrand Aktiefond Europa                  | 132 345 | 213,05 | 28 196 677           | 2,34 %               |
| Storebrand Aktiefond USA                     | 248 054 | 484,83 | 120 264 530          | 9,99 %               |
| Swedbank Robur Access Europa                 | 133 566 | 211,15 | 28 202 531           | 2,34 %               |
| Swedbank Robur Access Japan                  | 397 677 | 183,53 | 72 985 735           | 6,06 %               |
| Swedbank Robur Access USA                    | 210 017 | 571,33 | 119 989 072          | 9,97 %               |
| Öhman Etisk Emerging Markets                 | 248 669 | 223,14 | 55 487 940           | 4,61 %               |
| Öhman Etisk Index Pacific                    | 33 692  | 349,69 | 11 781 849           | 0,98 %               |
|  |         |        | <b>824 255 314</b>   | <b>68,47 %</b>       |
| <b>Räntefonder</b>                           |         |        |                      |                      |
| Captor Aster Global Credit A                 | 179 713 | 276,49 | 49 688 658           | 4,13 %               |
| Captor Aster Global Credit Short Term A      | 139 580 | 325,20 | 45 390 854           | 3,77 %               |
| Captor Iris Bond A                           | 973 222 | 258,95 | 252 015 793          | 20,94 %              |
| Storebrand Global Företagsobligations Plus A | 196 795 | 101,34 | 19 943 644           | 1,66 %               |
|  |         |        | <b>367 038 949</b>   | <b>30,49 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |         |        | <b>1 191 294 263</b> | <b>98,96 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |         |        | <b>1 191 294 263</b> | <b>98,96 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |         |        | <b>12 496 064</b>    | <b>1,04 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |         |        | <b>1 203 790 327</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Auto 5

Avanza Auto 5 är en specialfond (fondandelsfond). Aktieexponeringen i Avanza Auto 5 ligger normalt mellan 75 och 100 procent. Nuvarande allokering uppgår till drygt 85 procent. Autofondernas strategi är att genom modern portföljteori uppnå en optimerad tillgångssammansättning med syftet att långsiktigt generera en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning. Det sistnämnda med hänsyn tagen till fondens risknivå och övriga restriktioner såsom låga avgifter och hållbara investeringar.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 14,3 procent, vilket var mindre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 15,9 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 2,8 miljarder kronor till 3,8 miljarder kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Avanza Auto 5 hade ett bra år i absoluta termer där USA stått för den enskilt största bidragsgivaren till avkastningen. Relativt sitt jämförelseindex har fonden haft en undervikt mot USA vilket då självklart förklarar varför fonden inte presterat bättre. Exponeringen mot svenska långa statsobligationer har haft en fin utveckling under året. Fondens har under året minskat sin exponering mot EM och Pacific samt ökat sin exponering mot Japan, något som fallit ut väl.

Allokeringsstrategin för Avanza Auto-fonderna kommer att fortsätta utvecklas i riktning mot en ökad diversifiering med målsättningen att över tid uppnå en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.  
Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.  
Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Fondfakta

|  |                                       |
|--|---------------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2017-09-25                            |
| Andelsvärde  | 168,15                                |
| Fondförmögenhet, tkr   | 3 772 645                             |
| Utveckling, %  | 14,28                                 |
| Utv. jämförelseindex, %  | 15,90                                 |
| Kursnotering   | Daglig                                |
| Inträdesavgift   | Ingen                                 |
| Utträdesavgift   | Ingen                                 |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,34                                  |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,20                                  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                                  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                                  |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,22                                  |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                       |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning         |
| Förvaltare   | Anders Brommesson<br>Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-8986                           |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                       |

| Fondens 5 största innehav   | Exponering, tkr | % av fond |
|-----------------------------|-----------------|-----------|
| Captor Iris Bond A          | 522 378         | 13,85 %   |
| Storebrand Aktiefond USA    | 466 212         | 12,36 %   |
| Swedbank Robur Access USA   | 454 297         | 12,04 %   |
| Amundi Index Msci USA SRI   | 449 651         | 11,92 %   |
| Swedbank Robur Access Japan | 280 706         | 7,44 %    |

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risk som fonden är exponerad mot är den marknadsrisk som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk då somliga av fondens innehav kan vara svåra att likvidera. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

## Aktivitetsgrad

Avanza Auto 5s jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 72,25 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK 7,5 procent NASDAQ OMRX Total Markets TR SEK, 7,5 procent BbgBarc Global Aggregate TR Hdg SEK och 12,75 procent Morningstar Sweden NR. Det sammansatta indexet är relevant då det bäst speglar Avanza Auto 5s långsiktiga placeringsinriktning och dess sammansättning av tillgångsslag.

Avanza Auto 5 är en fondandelsfond där förvaltningen utgår från en modell. Avanza Auto 5s avkastning kommer över tid att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken blir därmed olika år från år.

Bedömningen är Avanza Auto 5s aktiva risk ligger inom det spann som den bör ligga inom. För information om aktiv risk se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

## Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|---|----------------|-----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 422 530        | -328 835        |
| Övriga finansiella intäkter               | 10 633         | 7 048           |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>433 163</b> | <b>-321 787</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -6 628         | -5 144          |
| Övriga finansiella kostnader              | -39            | -76             |
| Övriga kostnader                          | -              | -18             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-6 667</b>  | <b>-5 237</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>426 496</b> | <b>-327 024</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 3 742 130         | 2 727 754         |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>3 742 130</b>  | <b>2 727 754</b>  |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 29 805            | 24 079            |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 2 503             | 2 058             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>3 774 438</b>  | <b>2 753 891</b>  |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 1 792             | 1 371             |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>1 792</b>      | <b>1 371</b>      |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>3 772 645</b>  | <b>2 752 519</b>  |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|--|----------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                |                 |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                |                 |
| Realisationsvinster                          | 88 092         | 95 485          |
| Realisationsförluster                        | -5 305         | -46 993         |
| Orealiserade vinster/förluster               | 339 743        | -377 327        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>422 530</b> | <b>-328 835</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 2 752 519         | 2 629 719         |
| Andelsutgivning                           | 1 077 596         | 925 072           |
| Andelsinlösen                             | -483 965          | -475 247          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 426 496           | -327 024          |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>3 772 645</b>  | <b>2 752 519</b>  |



## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 3 772 645  | 2 752 520  | 2 629 719  | 1 515 561  | 1 165 752  |
| Andelsvärde              | 168,15     | 147,14     | 167,06     | 133,80     | 129,39     |
| Antal utestående andelar | 22 435 606 | 18 707 304 | 15 742 391 | 11 308 582 | 9 009 370  |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 14,28      | -11,92     | 24,65      | 3,58       | 24,01      |
| Jämförelseindex, %       | 15,90      | -8,63      | 25,78      | 1,06       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 2,18       | 2,13       | 3,11       | -          | -          |
|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 586 396    | 201 004    |            |            |            |
| Andelsvärde              | 104,34     | 106,29     |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 5 620 214  | 1 891 113  |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | -1,83      | 6,29       |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 1,33                    | 1 371,49      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 21,59                   | 11 427,89     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,22  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,20  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,34  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 39,45 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 13,15 |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 12,26 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 0,33  |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 10,01 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvalta fonder riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

### Övriga finansiella instrument

99,19 %

| Värdepapper                                  | Antal     | Kurs   | Marknadsvärde        | Andel av förmögenhet |
|--|-----------|--------|----------------------|----------------------|
| <b>Fondandelar</b>                           |           |        |                      |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                           |           |        |                      |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI       | 1 890 914 | 105,17 | 198 867 419          | 5,27 %               |
| Amundi Index Msci Europe SRI                 | 777 335   | 139,13 | 108 150 611          | 2,87 %               |
| Amundi Index Msci USA SRI                    | 2 510 056 | 179,14 | 449 651 452          | 11,92 %              |
| Avanza Sverige                               | 2 593 756 | 82,74  | 214 607 392          | 5,69 %               |
| FE Småbolag Sverige                          | 2 213 588 | 110,10 | 243 717 289          | 6,46 %               |
| Humle Småbolagsfond A                        | 398 942   | 650,76 | 259 615 595          | 6,88 %               |
| Storebrand Aktiefond Europa                  | 505 786   | 213,05 | 107 759 727          | 2,86 %               |
| Storebrand Aktiefond USA                     | 961 596   | 484,83 | 466 212 401          | 12,36 %              |
| Swedbank Robur Access Europa                 | 523 247   | 211,15 | 110 483 699          | 2,93 %               |
| Swedbank Robur Access Japan                  | 1 529 481 | 183,53 | 280 705 738          | 7,44 %               |
| Swedbank Robur Access USA                    | 795 158   | 571,33 | 454 297 405          | 12,04 %              |
| Öhman Etisk Emerging Markets                 | 900 399   | 223,14 | 200 915 038          | 5,33 %               |
| Öhman Etisk Index Pacific                    | 356 796   | 349,69 | 124 768 078          | 3,31 %               |
|  |           |        | <b>3 219 751 843</b> | <b>85,34 %</b>       |
| <b>Räntefonder</b>                           |           |        |                      |                      |
| Captor Iris Bond A                           | 2 017 293 | 258,95 | 522 377 946          | 13,85 %              |
|  |           |        | <b>522 377 946</b>   | <b>13,85 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |           |        | <b>3 742 129 789</b> | <b>99,19 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |           |        | <b>3 742 129 789</b> | <b>99,19 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |           |        | <b>30 515 675</b>    | <b>0,81 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |           |        | <b>3 772 645 464</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Auto 6

Avanza Auto 6 är en specialfond (fondandelsfond) och är den Avanza Auto-fonden med högst risknivå. Exponeringen mot aktier i Avanza Auto 6 ligger normalt mellan 85 och 100 procent. Nuvarande allokering uppgår till 99,4 procent. Autofondernas nuvarande strategi är att genom modern portföljteori uppnå en optimerad tillgångssammansättning med syftet att långsiktigt generera en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning. Det sistnämnda med hänsyn tagen till fondens risknivå och övriga restriktioner såsom låga avgifter och hållbara investeringar.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under året med 14,2 procent, vilket var mindre än sitt jämförelseindex som hade en utveckling på 17,8 procent under samma period. Fondförmögenheten ökade under perioden från 4,0 miljarder kronor till 5,2 miljarder kronor.

Det blev ett händelserikt år som startade med låga förhoppningar på marknaden, oro om en stundande recession och ett nytt krig. Snabba och kraftiga räntehöjningar från centralbankerna gav avtryck hos hushållen och företagen. Trots att centralbankerna var aggressiva med sin kvantitativa åtstramning fanns det signaler om att ekonomin höll emot, och främst i USA. Teknologiska framsteg inom AI gav även luft under vingarna. Återhållsam utveckling i Kina efter en återöppning av samhället efter Covid drog ner EM under året. Här hemma i Sverige stod fastighetsmarknaden och samhällsutveckling i fokus för investerare, nationella så väl som internationella. En kraftig försvagning av svenska kronan i början av året gynnade stora industriföretag samtidigt som svenska småbolag med känsligare finansieringsstruktur och i regel större exponering mot SEK hade det tuffare, även om småbolag avslutade året starkt samtidigt som kronan stärktes.

Avanza Auto 6 hade ett bra år i absoluta termer och slutet på året visade på en möjlig kommande revansch för svenska småbolag. I relativa termer har fondens undervikt mot USA varit negativt då USA gått bäst av tillgångsslagen samtidigt som fondens övervikt mot svenska småbolag varit något av ett ankare för avkastningen.

Sett till ändringar under året i allokeringen har fondens positionering mot övriga marknader fallit ut väl. Minskad exponering mot EM och ökad exponering mot Japan var de största ändringarna, och lyckade sådana.

Allokeringstrategin för Avanza Auto-fonderna kommer att fortsätta utvecklas i riktning mot en ökad diversifiering med målsättningen att över tid uppnå en konkurrenskraftig hög riskjusterad avkastning.

## Fondfakta

|  |                                       |
|--|---------------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2017-09-25                            |
| Andelsvärde  | 182,31                                |
| Fondförmögenhet, tkr   | 5 234 068                             |
| Utveckling, %  | 14,21                                 |
| Utv. jämförelseindex, %  | 17,84                                 |
| Kursnotering   | Daglig                                |
| Inträdesavgift   | Ingen                                 |
| Utträdesavgift   | Ingen                                 |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,36                                  |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,20                                  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,49                                  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                                  |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,18                                  |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                       |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning         |
| Förvaltare   | Anders Brommesson<br>Hampus Ernstsson |
| Organisationsnummer  | 515602-8994                           |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                       |

| Fondens 5 största innehav   | Exponering, tkr | % av fond |
|-----------------------------|-----------------|-----------|
| Storebrand Aktiefond USA    | 608 618         | 11,63 %   |
| Swedbank Robur Access USA   | 607 595         | 11,61 %   |
| Amundi Index Msci USA SRI   | 599 477         | 11,45 %   |
| Swedbank Robur Access Japan | 445 447         | 8,51 %    |
| Humble Småbolagsfond A      | 407 294         | 7,78 %    |

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fonden har möjlighet att placera i både aktie och räntebärande innehav. Fondens risk är därför starkt kopplat till den aktuella allokeringen mellan aktier och räntor. Den främsta risk som fonden är exponerad mot är den marknadsrisk som uppstår då priset på fondens aktieinnehav fluktuerar. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk. Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk då somliga av fondens innehav kan vara svåra att likvidera. Likviditetsrisken anses vara låg då fonden till stor del investerar i innehav med hög omsättning i förhållande till storleken på fondens positioner.

## Aktivitetsgrad

Avanza Auto 6s jämförelseindex är ett sammansatt index bestående av 85 procent Morningstar Gbl Mkts NR SEK och 15 procent Morningstar Sweden NR. Jämförelseindexet är relevant då det speglar Avanza Auto 6 långsiktiga placeringsinriktning.

Avanza Auto 6 är en fondandelsfond där förvaltningen utgår från en modell. Avanza Auto 6s avkastning kommer över tid att avvika från jämförelseindexet och den aktiva risken blir därmed olika år från år.

Bedömningen är att Auto 6s aktiva risk ligger inom det spann den bör ligga. För information om aktiv risk se tabell under "Fondens utveckling" nedan.

## Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|---|----------------|-----------------|
| Värdoförändring på fondandelar (Not 1)    | 588 966        | -512 136        |
| Övriga finansiella intäkter               | 16 361         | 11 766          |
| <b>Summa intäkter och värdoförändring</b> | <b>605 327</b> | <b>-500 370</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -9 436         | -7 651          |
| Övriga finansiella kostnader              | -30            | -59             |
| Övriga kostnader                          | -              | -25             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-9 466</b>  | <b>-7 735</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>595 861</b> | <b>-508 104</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 5 204 383         | 3 967 030         |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>5 204 383</b>  | <b>3 967 030</b>  |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 28 098            | 21 316            |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 4 098             | 3 028             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>5 236 579</b>  | <b>3 991 374</b>  |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 2 511             | 1 980             |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>2 511</b>      | <b>1 980</b>      |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>5 234 068</b>  | <b>3 989 394</b>  |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|--|----------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                |                 |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                |                 |
| Realisationsvinster                          | 170 720        | 91 868          |
| Realisationsförluster                        | -13            | -23 325         |
| Orealiserade vinster/förluster               | 418 259        | -580 679        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>588 966</b> | <b>-512 136</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 3 989 394         | 3 981 054         |
| Andelsutgivning                           | 1 491 756         | 1 363 227         |
| Andelsinlösen                             | -842 944          | -846 782          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 595 861           | -508 104          |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>5 234 068</b>  | <b>3 989 394</b>  |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 5 234 068  | 3 989 395  | 3 981 054  | 2 344 253  | 2 189 874  |
| Andelsvärde              | 182,31     | 159,63     | 181,97     | 141,27     | 136,94     |
| Antal utestående andelar | 28 708 985 | 24 991 733 | 21 884 971 | 16 563 471 | 15 991 860 |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 14,21      | -12,28     | 28,57      | 3,36       | 30,61      |
| Jämförelseindex, %       | 17,84      | -8,49      | 30,14      | 0,78       | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | 2,43       | 2,44       | 3,10       | -          | -          |
|                          | 2018-12-31 | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 1 241 559  | 488 395    |            |            |            |
| Andelsvärde              | 104,85     | 107,77     |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 11 841 402 | 4 532 122  |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | -2,71      | 7,77       |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 1,33                    | 1 362,54      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 21,74                   | 11 420,79     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,18  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,20  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>              | 0,36  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 30,15 |
| Transaktionskostnader, % <sup>2)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 14,06 |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 13,71 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 0,09  |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 11,70 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Transaktionskostnader, underliggande fonder tillkommer.

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicy vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicy är fastställd för att

uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltningsfonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

### Övriga finansiella instrument

99,43 %

| Värdepapper                                  | Antal     | Kurs     | Marknadsvärde        | Andel av förmögenhet |
|--|-----------|----------|----------------------|----------------------|
| <b>Fondandelar</b>                           |           |          |                      |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                           |           |          |                      |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets SRI       | 3 031 317 | 105,17   | 318 803 591          | 6,09 %               |
| Amundi Index Msci Europe SRI                 | 1 242 217 | 139,13   | 172 829 607          | 3,30 %               |
| Amundi Index Msci USA SRI                    | 3 346 414 | 179,14   | 599 476 569          | 11,45 %              |
| Avanza Sverige                               | 4 181 120 | 82,74    | 345 945 836          | 6,61 %               |
| FE Småbolag Sverige                          | 3 578 233 | 110,10   | 393 965 499          | 7,53 %               |
| Handelsbanken Amerika Småbolag (A SEK)       | 266 192   | 1 365,06 | 363 367 788          | 6,94 %               |
| Humle Småbolagsfond A                        | 625 874   | 650,76   | 407 293 871          | 7,78 %               |
| Storebrand Aktiefond Europa                  | 805 014   | 213,05   | 171 511 594          | 3,28 %               |
| Storebrand Aktiefond USA                     | 1 255 318 | 484,83   | 608 618 443          | 11,63 %              |
| Swedbank Robur Access Europa                 | 812 442   | 211,15   | 171 547 196          | 3,28 %               |
| Swedbank Robur Access Japan                  | 2 427 105 | 183,53   | 445 446 583          | 8,51 %               |
| Swedbank Robur Access USA                    | 1 063 474 | 571,33   | 607 594 800          | 11,61 %              |
| Öhman Etisk Emerging Markets                 | 1 471 722 | 223,14   | 328 400 118          | 6,27 %               |
| Öhman Etisk Index Pacific                    | 770 916   | 349,69   | 269 581 547          | 5,15 %               |
|  |           |          | <b>5 204 383 041</b> | <b>99,43 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |           |          | <b>5 204 383 041</b> | <b>99,43 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |           |          | <b>5 204 383 041</b> | <b>99,43 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |           |          | <b>29 685 004</b>    | <b>0,57 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |           |          | <b>5 234 068 045</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest

Fonden är en aktivt förvaltd aktiefond som placerar minst 90% av dess värde i aktier och aktierelaterade överlåtbara värdepapper utgivna av bolag vars produkter eller tjänster karaktäriseras av innovativa lösningar samt hög grad av forskning och utveckling. Fondens målsättning är att, med beaktande av fondens placeringsinriktning, uppnå högsta möjliga värdetillväxt av fondens tillgångar.

## Förvaltningsberättelse

Fonden lanserades den 27:e januari 2023 och har fram till årets slut haft en avkastning på 22,7 procent. Den totala fondförmögenheten uppgick vid årets slut till 485,6 miljoner.

Teknikaktier i USA har under året gått starkt trots kraftiga räntehöjningar från FED, mycket drivet av teknologiska framsteg inom AI. Inflationen har haft en fallande trend och ekonomin har presenterat starka siffror vilket reducerade oron på marknaden. Sett till hela året har dollarn blivit starkare mot kronan vilket varit positivt för USA-fonder. Sett till de sektorer vi hittar i fonden har teknik och krypto gått bäst samtidigt som hälsovård haft det tuffare.

Coinbase är det innehav som i särklass bidragit mest till avkastningen där innehavet i portföljen haft en uppgång under perioden på cirka 120%. Kryptovalutor har under året gjort något av en comeback. Efter Coinbase hittar vi Roku och UiPath som bästa bidragsgivare. I botten hittar vi däremot Intellia följt av Teladoc och Block. Både Intellia och Teladoc är verksamma inom hälsovård som haft det tufft under året på marknaden.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har enligt sina fondbestämmelser rätt att använda sig av derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning i syfte att effektivisera förvaltningen av tillgångarna i fonden. Under perioden har fonden inte nyttjat denna möjlighet. Fonden har inte lånat ut några värdepapper under 2023.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i marknadsrisk, likviditetsrisk, motpartsrisk, valutarisk och operativ risk.

Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest är en aktiefond och en investering i fonden är därmed förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk).

## Fondfakta

|                                       |  |
|---------------------------------------|--|
| Fondens startdatum                    | 2023-01-27                               |
| Andelsvärde                           | 122,65                                   |
| Fondförmögenhet, tkr                  | 485 610                                  |
| Utveckling, % <sup>1)</sup>           | 22,65                                    |
| Kursnotering                          | Daglig                                   |
| Inträdesavgift                        | Ingen                                    |
| Utträdesavgift                        | Ingen                                    |
| Avgifter, % <sup>2)</sup>             | 0,90                                     |
| Förvaltningsavgift, %                 | 0,90                                     |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, % | 1,20                                     |
| Omsättningshastighet, ggr             | 0,99                                     |
| Riskbedömningsmetod                   | Åtagandemetoden                          |
| Utdelning                             | Fonden lämnar ingen utdelning            |
| Förvaltare                            | Avanza Fonder i samarbete med ARK Invest |
| Organisationsnummer                   | 5156032665                               |

1) Sedan fondstart.

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

| Fondens 5 största innehav | Exponering, tkr | % av fond |
|---------------------------|-----------------|-----------|
| Coinbase Global Inc       | 44 267          | 9,12 %    |
| Roku Inc                  | 36 568          | 7,53 %    |
| Tesla Inc                 | 35 025          | 7,21 %    |
| Zoom Video                |                 |           |
| TELEKOMMUNIKATION Inc     | 33 731          | 6,95 %    |
| Block Inc                 | 32 708          | 6,74 %    |



Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna, kan det finnas en risk att inte kunna ta ut medel ur fonden inom utsatt tid (likviditetsrisk).

Det kan finnas en risk kopplad till att en motpart ställer in betalningarna eller i övrigt inte fullgör sina skyldigheter, exempelvis utifall att fonden tagit emot säkerheter för derivatinnehav eller för utlåning av värdepapper (motpartsrisk).

Om en investering görs i utländska värdepapper påverkas värdet i svenska kronor av växelkursen (valutarisk).

Vidare får fonden investera i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Avanza Disruptive Innovation by ARK använder inget jämförelseindex för att jämföra sin avkastning. Anledningen till det är att det inte bedöms finnas något index som är relevant för det placeringsuniversum fonden placerar i. Fonden redovisar således inte aktiv risk.

### Övrigt

Fonden startade och bytte även förvaringsinstitut under året.

### Resultaträkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Intäkter</b>                                    | <b>2023</b>   | <b>2022</b> |
|--|---------------|-------------|
| Värdeförändring på överlåtbara värdepapper (Not 1) | 48 188        | -           |
| Utdelningar  | 24            | -           |
| Valutakursvinster och -förluster netto             | 1             | -           |
| Övriga finansiella intäkter                        | 154           | -           |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b>          | <b>48 366</b> | <b>-</b>    |
| <b>Kostnader</b>                                   | <b>2023</b>   | <b>2022</b> |
| Förvaltningskostnader                              | -2 729        | -           |
| Övriga finansiella kostnader                       | -127          | -           |
| Övriga kostnader                                   | -193          | -           |
| <b>Summa kostnader</b>                             | <b>-3 050</b> | <b>-</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                              | <b>45 317</b> | <b>-</b>    |

1) Fonden startade 2023

## Balansräkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Överlåtbara värdepapper  | 484 379           | -                 |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>484 379</b>    | <b>-</b>          |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 2 169             | -                 |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>486 547</b>    | <b>-</b>          |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 937               | -                 |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>937</b>        | <b>-</b>          |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>485 610</b>    | <b>-</b>          |

1) Fonden startade 2023

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>   | <b>2022</b> |
|--|---------------|-------------|
| <b>Not 1</b>   |               |             |
| <b>Värdetförändring överlåtbara värdepapper</b>          |               |             |
| Realisationsvinster                                      | 30 879        | -           |
| Realisationsförluster                                    | -23 240       | -           |
| Orealiserade vinster/förluster                           | 40 548        | -           |
| <b>Summa värdetförändring på överlåtbara värdepapper</b> | <b>48 188</b> | <b>-</b>    |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Andelsutgivning                           | 709 140           | -                 |
| Andelsinlösen                             | -268 846          | -                 |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 45 317            | -                 |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>485 610</b>    | <b>-</b>          |

## Fondens utveckling

|                          | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> | <b>2021-12-31</b> | <b>2020-12-31</b> | <b>2019-12-31</b> |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 485 610           |                   |                   |                   |                   |
| Andelsvärde              | 122,65            |                   |                   |                   |                   |
| Antal utestående andelar | 3 959 268         |                   |                   |                   |                   |
| Utdelning kr/andel       | -                 |                   |                   |                   |                   |
| Totalavkastning, %       | 22,65             |                   |                   |                   |                   |
| Jämförelseindex, %       | -                 |                   |                   |                   |                   |
| Aktiv risk (2 år), %     | -                 |                   |                   |                   |                   |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | <b>Förvaltningskostnad, kr</b> | <b>Marknadsvärde</b> |
|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 5,18                           | 1 403,23             |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 85,79                          | 12 213,70            |

## Övrigt

|  | <b>2023</b> |
|--|-------------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,99        |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00        |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,90        |
| Avgifter, % 1)                         | 0,90        |
| Transaktionskostnader, tkr             | 320,31      |
| Transaktionskostnader, %               | 0,03        |
| Analyskostnader, tkr                   | 0           |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.

99,75 %

| Värdepapper                           | Antal   | Kurs     | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|---------------------------------------|---------|----------|--------------------|----------------------|
| <b>Noterade aktier</b>                |         |          |                    |                      |
| <b>Hälsovård</b>                      |         |          |                    |                      |
| 10X Genomics Inc                      | 21 232  | 55,96    | 11 968 637         | 2,46 %               |
| Beam Therapeutics Inc                 | 19 492  | 27,22    | 5 344 666          | 1,10 %               |
| Cerus Corp                            | 99 033  | 2,16     | 2 154 814          | 0,44 %               |
| CRISPR Therapeutics AG                | 24 793  | 62,60    | 15 634 338         | 3,22 %               |
| Exact Sciences Corp                   | 13 004  | 73,98    | 9 690 973          | 2,00 %               |
| Ginkgo Bioworks Holdings Inc          | 543 748 | 1,69     | 9 256 791          | 1,91 %               |
| Intellia Therapeutics Inc             | 35 110  | 30,49    | 10 783 614         | 2,22 %               |
| Invitae Corp                          | 161 289 | 0,63     | 1 018 380          | 0,21 %               |
| Moderna Inc                           | 3 413   | 99,45    | 3 419 142          | 0,70 %               |
| Pacific Biosciences of California Inc | 74 758  | 9,81     | 7 387 590          | 1,52 %               |
| Prime Medicine                        | 24 108  | 8,86     | 2 151 647          | 0,44 %               |
| Recursion Pharmaceuticals             | 68 025  | 9,86     | 6 756 496          | 1,39 %               |
| Teladoc Health Inc                    | 52 464  | 21,55    | 11 388 978         | 2,35 %               |
| Twist Bioscience Corp                 | 27 222  | 36,86    | 10 107 679         | 2,08 %               |
| Veracyte Inc                          | 34 623  | 27,51    | 9 594 699          | 1,98 %               |
| Verve Therapeutics Inc                | 18 907  | 13,94    | 2 654 981          | 0,55 %               |
|                                       |         |          | <b>119 313 425</b> | <b>24,57 %</b>       |
| <b>Sällanköpsvaror och -tjänster</b>  |         |          |                    |                      |
| 2U Inc                                | 48 034  | 1,23     | 595 155            | 0,12 %               |
| MERCADOLIBRE INC                      | 73      | 1 571,54 | 1 155 645          | 0,24 %               |
| Tesla Inc                             | 13 993  | 248,48   | 35 025 017         | 7,21 %               |
|                                       |         |          | <b>36 775 816</b>  | <b>7,57 %</b>        |
| <b>Industrivaror och -tjänster</b>    |         |          |                    |                      |
| ARCHER AVIATION INC                   | 70 494  | 6,14     | 4 360 102          | 0,90 %               |
|                                       |         |          | <b>4 360 102</b>   | <b>0,90 %</b>        |
| <b>Informationsteknik</b>             |         |          |                    |                      |
| Block Inc                             | 41 977  | 77,35    | 32 707 534         | 6,74 %               |
| Intuit Inc                            | 377     | 625,03   | 2 373 659          | 0,49 %               |
| Materialise NV ADR                    | 28 018  | 6,57     | 1 852 883          | 0,38 %               |
| NVIDIA Corp                           | 559     | 495,22   | 2 788 599          | 0,57 %               |
| PagerDuty Inc                         | 28 600  | 23,15    | 6 669 497          | 1,37 %               |
| Palantir Technologies Inc             | 62 181  | 17,17    | 10 754 843         | 2,21 %               |
| Pure Storage Inc Class A              | 6 972   | 35,66    | 2 504 464          | 0,52 %               |
| Schrodinger Inc                       | 11 571  | 35,80    | 4 172 823          | 0,86 %               |
| Shopify Inc                           | 20 211  | 77,90    | 15 859 933         | 3,27 %               |
| Teradyne                              | 7 707   | 108,52   | 8 425 025          | 1,73 %               |
| Twilio Inc                            | 27 106  | 75,87    | 20 716 272         | 4,27 %               |
| UiPath Inc                            | 85 034  | 24,84    | 21 277 484         | 4,38 %               |
| Unity Software Inc                    | 51 348  | 40,89    | 21 150 309         | 4,36 %               |
| Zoom Video TELEKOMMUNIKATION Inc      | 46 566  | 71,91    | 33 731 395         | 6,95 %               |
|                                       |         |          | <b>184 984 720</b> | <b>38,09 %</b>       |

**Finans och fastighet**

|                       |         |        |                   |                |
|-----------------------|---------|--------|-------------------|----------------|
| Coinbase Global Inc   | 25 267  | 173,92 | 44 266 918        | 9,12 %         |
| Robinhood Markets Inc | 120 131 | 12,74  | 15 417 026        | 3,17 %         |
|                       |         |        | <b>59 683 944</b> | <b>12,29 %</b> |

**Telekomoperatörer**

|                        |        |        |            |        |
|------------------------|--------|--------|------------|--------|
| Meta Platforms         | 2 144  | 353,96 | 7 644 605  | 1,57 % |
| PINTEREST INC- CLASS A | 14 800 | 37,04  | 5 522 157  | 1,14 % |
| Roblox Corp            | 46 269 | 45,72  | 21 309 459 | 4,39 % |
| Roku Inc               | 39 605 | 91,66  | 36 568 399 | 7,53 % |
| Spotify IT SA          | 2 389  | 187,91 | 4 522 120  | 0,93 % |
| Trade Desk (The)       | 5 096  | 71,96  | 3 693 998  | 0,76 % |

**79 260 738**      **16,32 %**

**Summa noterade aktier**

**484 378 746**      **99,75 %**

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.

**484 378 746**      **99,75 %**

**Övriga tillgångar och skulder (netto)**

**1 231 453**      **0,25 %**

**FONDFÖRMÖGENHET**

**485 610 198**      **100,00 %**

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Emerging Markets

Fonden är en matarfond som placerar minst 85 procent av sina medel i den passivt förvaltade mottagarfonden Amundi Index MSCI Emerging Markets och i dess andelsklass I13SK. Fondens målsättning är att ge andelsägarna en avkastning som överensstämmer med mottagarfondens utveckling. Mottagarfonden är en indexfond som har som mål att följa utvecklingen av sitt jämförelseindex.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 5,0 procent, vilket var 10 baspunkter sämre än mottagarfonden som ökade med 5,1 procent under samma period. Avanza Emerging Markets har under hela perioden varit i det närmaste fullt ut investerad i mottagarfonden.

Tillväxtmarknader totalt sett hade en positiv börsutveckling under året. Dock betydligt svagare utveckling jämfört med utvecklade marknader. Detta påverkades av geopolitiska spänningar och svag utveckling för den kinesiska ekonomin som är den största landsvikten i fonden.

De sektorer som hade störst positivt bidrag till fondens utveckling under året var informationsteknologi, finans och energi, medan sällanköpsvaror, kommunikationstjänster och hälsovård bidrog mest negativt under perioden. Fondens tre bästa bidragsgivare bland enskilda underliggande aktier var Taiwan Semiconductor Manufacturing, Samsung Electronics och PDD, medan Meituan, JD.com och Tencent utgjorde de tre sämsta bidragsgivarna.

Den totala fondförmögenheten ökade under året i Avanza Emerging Markets från 1,9 till 2,2 miljarder kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har inte möjlighet att använda sig av derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i motpartsrisk, marknadsrisk, likviditet- och valutarisk samt operativ risk.

Avanza Emerging Markets placerar sina medel i mottagarfonden, vilket ger en motpartrisk för fonden gentemot mottagarfonden. Mottagarfonden investerar även i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Då mottagarfonden investerar i aktier och derivat med exponering mot tillväxtmarknader är en investering i fonden förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk). Placeringar i aktier i tillväxtländer är förknippade med högre risk än de på mer etablerade aktiemarknader.

Marknadslikviditeten i aktier noterade i tillväxtmarknader kan vara lägre än på mer etablerade aktiemarknader. Det kan därför vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna finnas risk för att inte kunna sälja andelar i mottagarfonden inom utsatt tid (likviditetsrisk).

Fondens värde kan komma att påverkas av valutakursförändringar eftersom mottagarfonden placerar i aktier i andra valutor än i svenska kronor (valutarisk).

## Fondfakta

|  |                               |
|--|-------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2019-04-01                    |
| Andelsvärde  | 114,68                        |
| Fondförmögenhet, tkr   | 2 163 374                     |
| Utveckling, %  | 4,95                          |
| Kursnotering   | Daglig                        |
| Inträdesavgift   | Ingen                         |
| Utträdesavgift   | Ingen                         |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,27                          |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,15                          |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,15                          |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 0,12                          |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,02                          |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden               |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning |
| Förvaltare   | Martin Sandstedt              |
| Fondnummer hos PM  | 715955                        |
| Organisationsnummer  | 515603-0297                   |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                               |

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Fondens målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. Förvaltningen bedrivs genom att fondens medel placeras i mottagarfonden. Då förvaltningen av Fonden ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden. För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

### Övrigt

Information om mottagarfondens årsberättelse och halvårsredogörelse finns på [www.amundi.se](http://www.amundi.se).

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>   | <b>2022</b>     |
|---|---------------|-----------------|
| Värdetförändring på fondandelar (Not 1)   | 91 463        | -155 010        |
| Övriga finansiella intäkter               | 211           | 32              |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>91 674</b> | <b>-154 978</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>   | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -3 166        | -2 740          |
| Övriga finansiella kostnader              | -17           | -23             |
| Övriga kostnader                          | -             | -10             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-3 184</b> | <b>-2 774</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>88 490</b> | <b>-157 751</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 2 162 755         | 1 869 268         |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>2 162 755</b>  | <b>1 869 268</b>  |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 1 424             | 1 163             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>2 164 179</b>  | <b>1 870 431</b>  |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 805               | 688               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>805</b>        | <b>688</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>2 163 374</b>  | <b>1 869 742</b>  |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>   | <b>2022</b>     |
|--|---------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |               |                 |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |               |                 |
| Realisationsvinster                          | 3 019         | 2 072           |
| Realisationsförluster                        | -             | -329            |
| Orealiserade vinster/förluster               | 88 444        | -156 753        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>91 463</b> | <b>-155 010</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 1 869 742         | 1 843 685         |
| Andelsutgivning                           | 670 676           | 651 389           |
| Andelsinlösen                             | -465 534          | -467 581          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 88 490            | -157 751          |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>2 163 374</b>  | <b>1 869 742</b>  |

## Fondens utveckling

|                          | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> | <b>2021-12-31</b> | <b>2020-12-31</b> | <b>2019-12-31</b> |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 2 163 374         | 1 869 743         | 1 843 685         | 1 218 040         | 773 460           |
| Andelsvärde              | 114,68            | 109,27            | 118,92            | 111,01            | 107,33            |
| Antal utestående andelar | 18 863 780        | 17 111 722        | 15 503 083        | 10 972 311        | 7 206 202         |
| Utdelning kr/andel       | -                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| Totalavkastning, %       | 4,95              | -8,11             | 7,13              | 3,43              | 7,33              |
| Jämförelseindex, %       | -                 | -                 | -                 | -                 | -                 |
| Aktiv risk (2 år), %     | -                 | -                 | -                 | -                 | -                 |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | <b>Förvaltningskostnad, kr</b> | <b>Marknadsvärde</b> |
|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,98                           | 1 299,35             |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 15,76                          | 10 495,10            |



## Övrigt

|  | <b>2023</b> |
|--|-------------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,02        |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00        |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,15        |
| Avgifter, % 1)2)                       | 0,27        |
| Transaktionskostnader, tkr             | 17,27       |
| Transaktionskostnader, % 3)            | 0,01        |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 14,04       |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | -1,80       |
| Analyskostnader, tkr                   | 0           |

1) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 5 736 448 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

3) Transaktionskostnader tillkommer i mottagarfonden. Mottagarfondens årsberättelse finns att tillgå på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument         |            |        |                      | 99,97 %              |
|---------------------------------------|------------|--------|----------------------|----------------------|
| Värdepapper                           | Antal      | Kurs   | Marknadsvärde        | Andel av förmögenhet |
| Fondandelar                           |            |        |                      |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                    |            |        |                      |                      |
| Amundi Index Msci Emerging Markets    | 18 577 181 | 116,42 | 2 162 755 374        | 99,97 %              |
|                                       |            |        | <b>2 162 755 374</b> | <b>99,97 %</b>       |
| Summa fondandelar                     |            |        | 2 162 755 374        | 99,97 %              |
| Övriga finansiella instrument         |            |        | 2 162 755 374        | 99,97 %              |
| Övriga tillgångar och skulder (netto) |            |        | 619 072              | 0,03 %               |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                |            |        | <b>2 163 374 446</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Europa

Fonden är en matarfond som placerar minst 85 procent av sina medel i den passivt förvaltade mottagarfonden **Amundi Index MSCI Europe SRI PAB** och i dess andelsklass I13SK. Fondens målsättning är att ge andelsägarna en avkastning som överensstämmer med mottagarfondens utveckling. Mottagarfonden är en indexfond som har som mål att följa utvecklingen av sitt jämförelseindex, vilket beaktar miljö-, sociala och bolagsstyrningsaspekter (ESG).

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 15,3 procent, vilket var 10 baspunkter sämre än mottagarfonden som ökade med 15,4 procent under samma period. Avanza Europa har under hela perioden varit i det närmaste fullt ut investerad i mottagarfonden.

Trots geopolitiska spänningar, hög inflation och stigande räntor gav året positiv avkastning på den europeiska aktiemarknaden. Den svenska kronan var i stort sett oförändrad mot euron under året.

Fondens hållbara profil bidrog positivt till fondens avkastning under perioden, vilket framför allt kunde härledas till fondens undervikt mot energisektorn, vilken hade en svag utveckling under perioden.

De sektorer som bidrog mest positivt till fondens utveckling under året var industri, finans och sällanköpsvaror. Inga sektorer hade negativ avkastning under året. Fondens tre största positiva bidragsgivare bland enskilda underliggande aktier var Novo Nordisk, ASML Holding och Schneider Electric, medan Lonza Group, Genmab och Nokia utgjorde de tre sämsta bidragsgivarna under perioden.

Den totala fondförmögenheten ökade under året i Avanza Europa från 826,9 till 1 276,0 miljoner kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har inte möjlighet att använda sig av derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i motpartsrisk, marknadsrisk, likviditets- och valutarisk samt operativ risk.

Avanza Europa placerar sina medel i mottagarfonden, vilket ger en motpartrisk för fonden gentemot mottagarfonden. Mottagarfonden investerar även i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Då mottagarfonden investerar i aktier och derivat med exponering mot aktiemarknader är en investering i fonden förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk).

De underliggande aktieinnehaven i mottagarfonden kännetecknas generellt av god likviditet men vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna kan det finnas en risk att inte kunna sälja andelar i mottagarfonden inom utsatt tid (likviditetsrisk).

Mottagarfonden placerar i värdepapper som handlas i en annan valuta än svenska kronor och kan därför komma att påverkas av svängningar i valutakurser (valutarisk).

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller

## Fondfakta

|  |                               |
|--|-------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2020-02-05                    |
| Andelsvärde  | 132,33                        |
| Fondförmögenhet, tkr   | 1 275 985                     |
| Utveckling, %  | 15,33                         |
| Kursnotering   | Daglig                        |
| Inträdesavgift   | Ingen                         |
| Utträdesavgift   | Ingen                         |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 0,17                          |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,10                          |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,10                          |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 0,07                          |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,03                          |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden               |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning |
| Förvaltare   | Martin Sandstedt              |
| Organisationsnummer  | 515603-0693                   |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                               |

rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Fondens målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. Förvaltningen bedrivs genom att fondens medel placeras i mottagarfonden. Då förvaltningen av Fonden ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden. För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

### Övrigt

Information om mottagarfondens årsberättelse och halvårsredogörelse finns på [www.amundi.com](http://www.amundi.com). Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

Efter årsskiftet ansökte fonden om att få ändra sina fondbestämmelser. Ändringen medför att fonden går från att vara en matarfond till att bli en aktiefond. Ändringen är planerad till våren 2024.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>    |
|---|----------------|----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 139 068        | -57 224        |
| Övriga finansiella intäkter               | 119            | 10             |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>139 187</b> | <b>-57 214</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>    |
| Förvaltningskostnader                     | -1 120         | -765           |
| Övriga finansiella kostnader              | -24            | -7             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-1 144</b>  | <b>-772</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>138 043</b> | <b>-57 986</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 1 275 741         | 826 179           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>1 275 741</b>  | <b>826 179</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 553               | 961               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>1 276 295</b>  | <b>827 140</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 310               | 203               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>310</b>        | <b>203</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>1 275 985</b>  | <b>826 937</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>    | <b>2022</b>    |
|--|----------------|----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                |                |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                |                |
| Realisationsvinster                          | 5 550          | 4 613          |
| Realisationsförluster                        | -              | -117           |
| Orealiserade vinster/förluster               | 133 518        | -61 720        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>139 068</b> | <b>-57 224</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 826 937           | 779 569           |
| Andelsutgivning                           | 602 077           | 369 630           |
| Andelsinlösen                             | -291 073          | -264 276          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 138 043           | -57 986           |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>1 275 985</b>  | <b>826 937</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> | <b>2021-12-31</b> | <b>2020-12-31</b> | <b>2019-12-31</b> |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 1 275 985         | 826 937           | 779 569           | 292 116           |                   |
| Andelsvärde              | 132,33            | 114,74            | 123,54            | 95,04             |                   |
| Antal utestående andelar | 9 642 773         | 7 207 217         | 6 310 404         | 3 073 749         |                   |
| Utdelning kr/andel       | -                 | -                 | -                 | -                 |                   |
| Totalavkastning, %       | 15,33             | -7,12             | 29,99             | -4,96             |                   |
| Jämförelseindex, %       | -                 | -                 | -                 | -                 |                   |
| Aktiv risk (2 år), %     | -                 | 1,41              | -                 | -                 |                   |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | <b>Förvaltningskostnad, kr</b> | <b>Marknadsvärde</b> |
|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,67                           | 1 349,46             |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 11,10                          | 11 533,03            |

## Övrigt

|  | <b>2023</b> |
|--|-------------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,03        |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00        |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,10        |
| Avgifter, % 1)2)                       | 0,17        |
| Transaktionskostnader, tkr             | 24,05       |
| Transaktionskostnader, % 3)            | 0,01        |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 13,72       |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 3,50        |
| Analyskostnader, tkr                   | 0           |

1) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 1 846 585 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

3) Transaktionskostnader tillkommer i mottagarfonden. Mottagarfondens årsberättelse finns att tillgå på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Värdepapper                           | Antal     | Kurs   | Marknadsvärde        | Andel av förmögenhet |
|---------------------------------------|-----------|--------|----------------------|----------------------|
| Fondandelar                           |           |        |                      | 99,98 %              |
| <b>Aktiefonder</b>                    |           |        |                      |                      |
| Amundi Index Msci Europe SRI          | 9 169 418 | 139,13 | 1 275 741 112        | 99,98 %              |
|                                       |           |        | <b>1 275 741 112</b> | <b>99,98 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>              |           |        | <b>1 275 741 112</b> | <b>99,98 %</b>       |
| Övriga finansiella instrument         |           |        | 1 275 741 112        | 99,98 %              |
| Övriga tillgångar och skulder (netto) |           |        | 243 806              | 0,02 %               |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                |           |        | <b>1 275 984 918</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Fastighet by Norhammar

Fonden är en aktiefond som placerar i aktier och aktierelaterade överlåtbara värdepapper utgivna av fastighets-, bygg samt fastighetsutvecklingsbolag i Norden. Målsättningen är att överträffa utvecklingen för Fondens jämförelseindex som är SIX Nordic Real Estate.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 20,5 procent. Fondens jämförelseindex ökade under samma period med 12,8 procent.

Börsåret 2023 blev ett händelserikt år med inledningsvis positiva tongångar och optimism, men som sedan kom att präglas av konjunktur- och ränteoro samt ökade geopolitiska spänningar. Den fundamentala utvecklingen i flertalet av fastighetsbolagen har under året fortsatt sett stabil ut, trots att aktiekurserna stundom inte speglar detta. När inflationssiffrorna i slutet av året började vika och den penningpolitiska kommunikationen blev allt mer avvaktande vek långräntorna nedåt, vilket ledde till ett mer optimistiskt börshumor och särskilt för fastighetsaktier.

De största bidragsgivarna under året var Balder, följt av Castellum och Nyfosa. De största negativa bidragen under året kom från Fastpartner, KMC Properties och Brinova.

## Fondfakta

|   |                               |
|---|-------------------------------|
| Fondens startdatum  | 2022-02-11                    |
| Andelsvärde   | 77,87                         |
| Fondförmögenhet, tkr  | 295 882                       |
| Utveckling, %   | 20,54                         |
| Utv. jämförelseindex, %   | 12,81                         |
| Kursnotering  | Daglig                        |
| Inträdesavgift  | Ingen                         |
| Utträdesavgift  | Ingen                         |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>   | 1,07                          |
| Förvaltningsavgift, %   | 1,00                          |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %                                       | 1,20                          |
| Omsättningshastighet, ggr   | 0,17                          |
| Riskbedömningsmetod   | Åtagandemetoden               |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning |
| Förvaltare  | Peter Norhammar               |
| Organisationsnummer   | 515603-1949                   |
| 1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, % |                               |

| Fondens 5 största innehav | Exponering, tkr | % av fond |
|---------------------------|-----------------|-----------|
| FASTIGHETS AB BALDER-B    | 27 335          | 9,24 %    |
| Castellum AB              | 27 127          | 9,17 %    |
| SAGAX B                   | 25 038          | 8,46 %    |
| NYFOSA                    | 18 422          | 6,23 %    |
| CATENA                    | 17 471          | 5,90 %    |

Den totala fondförmögenheten ökade under året från 158,1 till 295,9 miljoner kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har enligt sina fondbestämmelser rätt att använda sig av derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning i syfte att effektivisera förvaltningen av tillgångarna i fonden. Under perioden har fonden inte nyttjat denna möjlighet. Fonden har inte lånat ut några värdepapper under 2023.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i marknadsrisk, koncentrationsrisk, likviditetsrisk, motpartsrisk och operativ risk. Avanza Fastighet by Norhammar är en aktiefond och en investering i fonden är därmed förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk). Eftersom fondens placeringar är koncentrerade till en enskild bransch så har fonden normalt något högre risk än för fonder med placeringar i flera branscher (koncentrationsrisk). Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna kan det finnas en risk att inte kunna ta ut medel ur fonden inom utsatt tid (likviditetsrisk). Vidare får fonden investera i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk. Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser. Fondens värde kan komma att påverkas av valutakursförändringar eftersom fonden placerar i aktier i andra valutor än i svenska kronor (valutarisk).



## Aktivitetsgrad

Avanza Fastighet by Norhammars jämförelseindex är SIX Nordic Real Estate. Indexet är relevant då det representerar det placeringsuniversum fonden placerar i. Fondens mål är att överträffa utvecklingen för fondens jämförelseindex.

Aktiv risk beräknas på 24 månaders historik. Avanza Fastighet by Norhammar har inte tillräckligt lång historik för att redovisa aktiv risk.

## Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                                   | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|---|---------------|----------------|
| Värdförändring på överlåtbara värdepapper (Not 1) | 43 913        | -71 506        |
| Utdelningar                                       | 3 517         | 3 473          |
| Valutakursvinster och -förluster netto            | 261           | 140            |
| Övriga finansiella intäkter                       | 195           | 97             |
| <b>Summa intäkter och värdförändring</b>          | <b>47 886</b> | <b>-67 797</b> |
| <b>Kostnader</b>                                  | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
| Förvaltningskostnader                             | -1 850        | -1 341         |
| Övriga finansiella kostnader                      | -133          | -126           |
| Övriga kostnader                                  | -82           | -160           |
| <b>Summa kostnader</b>                            | <b>-2 065</b> | <b>-1 627</b>  |
| <b>Årets resultat</b>                             | <b>45 821</b> | <b>-69 424</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Överlåtbara värdepapper  | 287 968           | 149 625           |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>287 968</b>    | <b>149 625</b>    |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 8 518             | 8 883             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>296 486</b>    | <b>158 509</b>    |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 604               | 440               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>604</b>        | <b>440</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>295 882</b>    | <b>158 068</b>    |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>   | <b>2022</b>    |
|--|---------------|----------------|
| <b>Not 1</b>   |               |                |
| <b>Värdetförändring överlåtbara värdepapper</b>          |               |                |
| Realisationsvinster                                      | 2 554         | 108            |
| Realisationsförluster                                    | -6 350        | -24 620        |
| Orealiserade vinster/förluster                           | 47 709        | -46 995        |
| <b>Summa värdetförändring på överlåtbara värdepapper</b> | <b>43 913</b> | <b>-71 506</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 158 068           | -                 |
| Andelsutgivning                           | 207 618           | 358 311           |
| Andelsinlösen                             | -115 625          | -130 820          |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 45 821            | -69 424           |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>295 882</b>    | <b>158 068</b>    |

## Fondens utveckling

|                          | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> | <b>2021-12-31</b> | <b>2020-12-31</b> | <b>2019-12-31</b> |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 295 882           | 158 068           |                   |                   |                   |
| Andelsvärde              | 77,87             | 64,60             |                   |                   |                   |
| Antal utestående andelar | 3 799 930         | 2 446 934         |                   |                   |                   |
| Utdelning kr/andel       | -                 | -                 |                   |                   |                   |
| Totalavkastning, %       | 20,54             | -35,40            |                   |                   |                   |
| Jämförelseindex, %       | 12,81             | -34,50            |                   |                   |                   |
| Aktiv risk (2 år), %     | -                 | -                 |                   |                   |                   |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | <b>Förvaltningskostnad, kr</b> | <b>Marknadsvärde</b> |
|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 6,32                           | 1 603,21             |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 96,65                          | 12 054,18            |

## Övrigt

|  | <b>2023</b> |
|--|-------------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,17        |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00        |
| Förvaltningsavgift, %                  | 1,00        |
| Avgifter, % 1)                         | 1,07        |
| Transaktionskostnader, tkr             | 94,76       |
| Transaktionskostnader, %               | 0,06        |
| Analyskostnader, tkr                   | 120         |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.

97,33 %

| Värdepapper   | Antal     | Kurs   | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|---|-----------|--------|--------------------|----------------------|
| <b>Noterade aktier</b>  |           |        |                    |                      |
| <b>Finans och fastighet</b>   |           |        |                    |                      |
| Atrium Ljungberg AB   | 56 254    | 231,20 | 13 005 925         | 4,40 %               |
| BRINOVA FASTIGHETER B   | 47 496    | 19,35  | 919 048            | 0,31 %               |
| Castellum AB  | 189 300   | 143,30 | 27 126 690         | 9,17 %               |
| CATENA  | 37 062    | 471,40 | 17 471 027         | 5,90 %               |
| CIBUS NORDIC FINANS   | 89 874    | 133,90 | 12 034 129         | 4,07 %               |
| Dios Fastigheter AB   | 155 200   | 86,60  | 13 440 320         | 4,54 %               |
| Emilshus B  | 404 785   | 31,80  | 12 872 163         | 4,35 %               |
| FABEGE  | 122 500   | 108,20 | 13 254 500         | 4,48 %               |
| FASTIGHETS AB BALDER-B  | 382 200   | 71,52  | 27 334 944         | 9,24 %               |
| FASTPARTNER AB-A  | 106 394   | 62,70  | 6 670 904          | 2,25 %               |
| KMC PROPERTIES ASA  | 1 177 948 | 6,40   | 7 477 048          | 2,53 %               |
| Logistea B  | 485 000   | 12,50  | 6 062 500          | 2,05 %               |
| NP3 FASTIGHETER   | 56 849    | 233,00 | 13 245 817         | 4,48 %               |
| NYFOSA  | 192 200   | 95,85  | 18 422 370         | 6,23 %               |
| PANDOX B  | 87 900    | 150,40 | 13 220 160         | 4,47 %               |
| PLATZER FASTIGHETER HOLD  | 157 632   | 84,20  | 13 272 614         | 4,49 %               |
| SAGAX B   | 90 258    | 277,40 | 25 037 569         | 8,46 %               |
| STENHUS FASTIGHETER I NORDEN  | 961 997   | 10,50  | 10 100 969         | 3,41 %               |
| Swedish Logistic Property B   | 374 139   | 32,55  | 12 178 224         | 4,12 %               |
| TRIANON B   | 35 520    | 16,75  | 594 960            | 0,20 %               |
| WALLENSTAM B  | 91 518    | 54,70  | 5 006 035          | 1,69 %               |
| WIHLBORGS FASTIGHETER AB  | 141 400   | 94,25  | 13 326 950         | 4,50 %               |
|   |           |        | <b>282 074 865</b> | <b>95,33 %</b>       |
| <b>Sällanköpsvaror och -tjänster</b>  |           |        |                    |                      |
| JM AB   | 33 200    | 177,50 | 5 893 000          | 1,99 %               |
|   |           |        | <b>5 893 000</b>   | <b>1,99 %</b>        |
| <b>Summa noterade aktier</b>  |           |        | <b>287 967 865</b> | <b>97,33 %</b>       |
| <b>Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.</b> |           |        | <b>287 967 865</b> | <b>97,33 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b>  |           |        | <b>7 914 047</b>   | <b>2,67 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>  |           |        | <b>295 881 912</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Global

Fonden är en matarfond som placerar minst 85 procent av sina medel i den passivt förvaltade mottagarfonden **Amundi Index MSCI World** och i dess andelsklass **I13SK**. Fondens målsättning är att ge andelsägarna en avkastning som överensstämmer med mottagarfondens utveckling. Mottagarfonden är en indexfond som har som mål att följa utvecklingen av sitt jämförelseindex.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 19,9 procent, vilket var 10 baspunkter sämre än mottagarfonden som ökade med 20,0 procent under samma period. Avanza Global har under hela perioden varit i det närmaste fullt ut investerad i mottagarfonden.

Trots geopolitiska spänningar, hög inflation och stigande räntor gav året positiv avkastning på den globala aktiemarknaden. Uppgången kan till viss del förklaras av AI-boomen som lett till kraftiga uppgångar i de amerikanska teknikjättarna. Den svenska kronan stärktes något mot US-dollar och var i stort sett oförändrad mot euron under året.

De sektorer som hade störst positivt bidrag till fondens utveckling under året var informationsteknik, sällanköpsvaror och kommunikationstjänster, medan dagligvaror och kraftförsörjning bidrog något negativt under perioden. Fondens tre bästa bidragsgivare bland enskilda underliggande aktier var Apple, Microsoft och NVIDIA, medan Pfizer, Chevron och Johnson & Johnson utgjorde de tre sämsta bidragsgivarna.

Den totala fondförmögenheten ökade under året i Avanza Global från 13,0 till 21,1 miljarder kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har inte möjlighet att använda sig av derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i motpartrisk, marknadsrisk, likviditet- och valutarisk samt operativ risk.

Avanza Global placerar sina medel i mottagarfonden, vilket ger en motpartrisk för fonden gentemot mottagarfonden. Mottagarfonden investerar även i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartrisk.

Då mottagarfonden investerar i globala aktier och derivat med exponering mot aktiemarknader är en investering i Avanza Global förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk).

De underliggande aktieinnehaven i mottagarfonden kännetecknas generellt av god likviditet, men vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna kan det finnas risk för att inte kunna sälja andelar i mottagarfonden inom utsatt tid (likviditetsrisk).

De globala aktierna som ingår i mottagarfonden handlas på ett flertal länders aktiemarknader och är noterade i ett flertal olika underliggande valutor vilka också förändras i förhållande till den svenska kronan och därmed påverkar utvecklingen för de underliggande tillgångarna i Avanza Global (valutarisk).

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

## Fondfakta

|   |                               |
|---|-------------------------------|
| Fondens startdatum                                  | 2018-08-27                    |
| Andelsvärde   | 175,99                        |
| Fondförmögenhet, tkr                                | 21 067 519                    |
| Utveckling, %                                       | 19,92                         |
| Kursnotering  | Daglig                        |
| Inträdesavgift                                      | Ingen                         |
| Utträdesavgift                                      | Ingen                         |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>                           | 0,08                          |
| Förvaltningsavgift, %                               | 0,05                          |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %               | 0,05                          |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, % | 0,03                          |
| Omsättningshastighet, ggr                           | 0,00                          |
| Riskbedömningsmetod                                 | Åtagandemetoden               |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning |
| Förvaltare  | Martin Sandstedt              |
| Fondnummer hos PM                                   | 680124                        |
| Organisationsnummer                                 | 515603-0016                   |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Fondens målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. Förvaltningen bedrivs genom att fondens medel placeras i mottagarfonden. Då förvaltningen av Fonden ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden. För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

### Övrigt

Information om mottagarfondens årsberättelse och halvårsredogörelse finns på [www.amundi.com](http://www.amundi.com). Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

Efter årsskiftet ansökte fonden om att få ändra sina fondbestämmelser. Ändringen medför att fonden går från att vara en matarfond till att bli en aktiefond. Förändringen är planerad till hösten 2024.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>      | <b>2022</b>     |
|---|------------------|-----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 2 825 312        | -727 191        |
| Övriga finansiella intäkter               | 2 749            | 279             |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>2 828 061</b> | <b>-726 912</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>      | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -8 651           | -5 967          |
| Övriga finansiella kostnader              | -20              | -32             |
| Övriga kostnader                          | -                | -12             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-8 671</b>    | <b>-6 010</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>2 819 390</b> | <b>-732 923</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 21 063 912        | 12 973 075        |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>21 063 912</b> | <b>12 973 075</b> |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 6 136             | 4 505             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>21 070 048</b> | <b>12 977 580</b> |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 2 529             | 1 624             |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>2 529</b>      | <b>1 624</b>      |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>21 067 519</b> | <b>12 975 956</b> |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>      | <b>2022</b>     |
|--|------------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                  |                 |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                  |                 |
| Realisationsvinster                          | 19 718           | 68 310          |
| Orealiserade vinster/förluster               | 2 805 593        | -795 501        |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>2 825 312</b> | <b>-727 191</b> |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 12 975 956        | 11 175 866        |
| Andelsutgivning                           | 7 936 563         | 5 004 776         |
| Andelsinlösen                             | -2 664 390        | -2 471 764        |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 2 819 390         | -732 923          |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>21 067 519</b> | <b>12 975 956</b> |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31  | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|-------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 21 067 519  | 12 975 956 | 11 175 866 | 5 566 913  | 4 261 180  |
| Andelsvärde              | 175,99      | 146,76     | 156,09     | 116,21     | 114,21     |
| Antal utestående andelar | 119 709 286 | 88 416 504 | 71 600 917 | 47 905 562 | 37 309 254 |
| Utdelning kr/andel       | -           | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 19,92       | -5,98      | 34,32      | 1,75       | 34,19      |
| Jämförelseindex, %       | -           | -          | -          | -          | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | -           | -          | -          | -          | -          |
|                          | 2018-12-31  | 2017-12-31 | 2016-12-31 | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 1 162 877   |            |            |            |            |
| Andelsvärde              | 85,11       |            |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 13 663 224  |            |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -           |            |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | -15,09      |            |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -           |            |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -           |            |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,34                    | 1 380,62      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 5,64                    | 11 991,69     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,00  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,05  |
| Avgifter, % <sup>1)2)</sup>            | 0,08  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 20,33 |
| Transaktionskostnader, % <sup>3)</sup> | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 14,11 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 6,18  |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 15,64 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 13 847 903 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

3) Transaktionskostnader tillkommer i mottagarfonden. Mottagarfondens årsberättelse finns att tillgå på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicy vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicy är fastställd för att



uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvalta fonder riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |             |        |                       | 99,98 %              |
|--|-------------|--------|-----------------------|----------------------|
| Värdepapper                                  | Antal       | Kurs   | Marknadsvärde         | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                           |             |        |                       |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                           |             |        |                       |                      |
| Amundi Msci World                            | 119 409 932 | 176,40 | 21 063 911 998        | 99,98 %              |
|  |             |        | <u>21 063 911 998</u> | <u>99,98 %</u>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |             |        | <u>21 063 911 998</u> | <u>99,98 %</u>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |             |        | <u>21 063 911 998</u> | <u>99,98 %</u>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |             |        | <u>3 606 511</u>      | <u>0,02 %</u>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |             |        | <u>21 067 518 508</u> | <u>100,00 %</u>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult

Fonden är en global aktiefond som investerar i bolag inom läkemedel, bioteknik, laboratorieutrustning, diagnostik, förebyggande vård och andra relaterade branscher. Fonden är en artikel 9-fond och har som mål att investera i företag med produkter och tjänster som bidrar till att uppfylla FN:s globala hållbarhetsmål om god hälsa och välbefinnande (enligt Agenda 2030).

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade sedan fondens start den 26 maj till och med den sista handelsdagen 2023 med 0,9 procent. Fondens jämförelseindex minskade under samma period med 1,5 procent.

Fondens tre bästa bidragsgivare under perioden var Eli Lilly, Novo Nordisk och Fusion Pharmaceuticals. De sämsta bidragen kom från AstraZeneca, Lonza och Merck. Eli Lilly och Novo Nordisk steg efter fortsatt stark efterfrågan för nya obesitasmediciner och en klinisk studie som visat på en skyddande effekt på hjärtat. Inom cancerområdet investerade fonden särskilt i teknologierna "smarta cellgifter" och "smart strålning". Bland dessa investeringar steg både Fusion Pharmaceuticals och ImmunoGen kraftigt, medan AstraZenecas data avseende lungcancer inte levde upp till förväntningarna. Fonden hade flera investeringar inom sällsynta sjukdomar, vilka också bidrog positivt till fondens utveckling. Däremot var utvecklingen fortsatt svag för bolag med covidrelaterad försäljning. Ett exempel är Lonza som är leverantör till läkemedelsbolag, men även Pfizer och Moderna utvecklades svagt under perioden.

Den totala fondförmögenheten uppgick vid halvårets slut till 161,3 miljoner kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har enligt sina fondbestämmelser rätt att använda sig av derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning i syfte att effektivisera förvaltningen av tillgångarna i fonden. Under perioden har fonden inte nyttjat denna möjlighet. Fonden har inte lånat ut några värdepapper under 2023.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i marknadsrisk, koncentrationsrisk, likviditetsrisk, motpartsrisk och operativ risk.

Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult är en aktiefond och en investering i fonden är därmed förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk).

## Fondfakta

|                                       |                                 |
|---------------------------------------|---------------------------------|
| Fondens startdatum                    | 2023-05-26                      |
| Andelsvärde                           | 100,92                          |
| Fondförmögenhet, tkr                  | 161 264                         |
| Utveckling, % <sup>1)</sup>           | 0,92                            |
| Utv. jämförelseindex, %               | -1,46                           |
| Kursnotering                          | Daglig                          |
| Inträdesavgift                        | Ingen                           |
| Utträdesavgift                        | Ingen                           |
| Avgifter, % <sup>2)</sup>             | 1,17                            |
| Förvaltningsavgift, %                 | 1,15                            |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, % | 1,50                            |
| Omsättningshastighet, ggr             | 0,39                            |
| Riskbedömningsmetod                   | Åtagandemetoden                 |
| Utdelning                             | Fonden lämnar ingen utdelning   |
| Förvaltare                            | Astrid Samuelsson, Ellinor Hult |
| Organisationsnummer                   | 5156025966                      |

1) Sedan fondstart.

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

| Fondens 5 största innehav     | Exponering, tkr | % av fond |
|-------------------------------|-----------------|-----------|
| United Healthgroup Inc        | 12 622          | 7,83 %    |
| Eli Lilly & Co                | 11 996          | 7,44 %    |
| Novo Nordisk B                | 9 856           | 6,11 %    |
| Merck & Co. Inc               | 9 346           | 5,80 %    |
| Thermo Fisher Scientific Corp | 7 812           | 4,84 %    |

Eftersom fondens placeringar är koncentrerade till en enskild bransch och ett mindre antal aktier så har fonden normalt något högre risk än för fonder med placeringar i flera branscher (koncentrationsrisk).

Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna, kan det finnas en risk att inte kunna ta ut medel ur fonden inom utsatt tid (likviditetsrisk).

Vidare får fonden investera i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningssvappar.

### Aktivitetsgrad

Avanza Healthcare by Samuelsson & Hults jämförelseindex är Morningstar Developed Markets Healthcare Target Market Exposure NR USD. Indexet är relevant då det representerar det placeringsuniversum fonden placerar i.

Aktiv risk beräknas på 24 månaders historik. Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult har inte tillräckligt lång historik för att redovisa aktiv risk.

### Övrigt

Fonden startade under året.

### Resultaträkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Intäkter</b>                                     | <b>2023</b>   | <b>2022</b> |
|---|---------------|-------------|
| Värdetförändring på överlåtbara värdepapper (Not 1) | -146          | -           |
| Utdelningar   | 806           | -           |
| Valutakursvinster och -förluster netto              | -419          | -           |
| Övriga finansiella intäkter                         | 131           | -           |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b>           | <b>373</b>    | <b>-</b>    |
| <b>Kostnader</b>                                    | <b>2023</b>   | <b>2022</b> |
| Förvaltningskostnader                               | -1 056        | -           |
| Övriga finansiella kostnader                        | -47           | -           |
| Övriga kostnader                                    | -154          | -           |
| <b>Summa kostnader</b>                              | <b>-1 257</b> | <b>-</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                               | <b>-885</b>   | <b>-</b>    |

1) Fonden startade 2023

## Balansräkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Överlåtbara värdepapper  | 156 491           | -                 |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>156 491</b>    | <b>-</b>          |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 5 275             | -                 |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 5                 | -                 |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>161 771</b>    | <b>-</b>          |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 507               | -                 |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>507</b>        | <b>-</b>          |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>161 264</b>    | <b>-</b>          |

1) Fonden startade 2023

## Tilläggsupplysningar, tkr

|   | <b>2023</b> | <b>2022</b> |
|---|-------------|-------------|
| <b>Not 1</b>  |             |             |
| <b>Värdeförändring överlåtbara värdepapper</b>          |             |             |
| Realisationsvinster                                     | 3 460       | -           |
| Realisationsförluster                                   | -7 394      | -           |
| Orealiserade vinster/förluster                          | 3 788       | -           |
| <b>Summa värdeförändring på överlåtbara värdepapper</b> | <b>-146</b> | <b>-</b>    |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Andelsutgivning                           | 217 251           | -                 |
| Andelsinlösen                             | -55 102           | -                 |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | -885              | -                 |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>161 264</b>    | <b>-</b>          |

## Fondens utveckling

|                          | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> | <b>2021-12-31</b> | <b>2020-12-31</b> | <b>2019-12-31</b> |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 161 264           |                   |                   |                   |                   |
| Andelsvärde              | 100,92            |                   |                   |                   |                   |
| Antal utestående andelar | 1 597 998         |                   |                   |                   |                   |
| Utdelning kr/andel       | -                 |                   |                   |                   |                   |
| Totalavkastning, %       | 0,92              |                   |                   |                   |                   |
| Jämförelseindex, %       | -1,46             |                   |                   |                   |                   |
| Aktiv risk (2 år), %     | -                 |                   |                   |                   |                   |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | <b>Förvaltningskostnad, kr</b> | <b>Marknadsvärde</b> |
|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 2,64                           | 801,80               |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 67,00                          | 10 043,79            |

## Övrigt

|  | <b>2023</b> |
|--|-------------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,39        |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00        |
| Förvaltningsavgift, %                  | 1,15        |
| Avgifter, % 1)                         | 1,17        |
| Transaktionskostnader, tkr             | 162,55      |
| Transaktionskostnader, %               | 0,06        |
| Analyskostnader, tkr                   | 34          |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningsystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

**Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.**

**97,04 %**

| Värdepapper                | Antal  | Kurs      | Marknadsvärde | Andel av förmögenhet |
|----------------------------|--------|-----------|---------------|----------------------|
| <b>Noterade aktier</b>     |        |           |               |                      |
| <b>Hälsovård</b>           |        |           |               |                      |
| AbbVie Inc                 | 2 763  | 154,97    | 4 313 250     | 2,67 %               |
| Akero Therapeutics Inc     | 2 365  | 23,35     | 556 281       | 0,34 %               |
| Ambrx Biopharma ADR        | 7 120  | 14,24     | 1 021 330     | 0,63 %               |
| Amgen Inc                  | 2 063  | 288,02    | 5 985 466     | 3,71 %               |
| Amicus Therapeutics, Inc   | 6 644  | 14,19     | 949 704       | 0,59 %               |
| Arcellx Inc                | 1 465  | 55,50     | 819 043       | 0,51 %               |
| Argenx SE                  | 402    | 343,50    | 1 537 944     | 0,95 %               |
| ASTRA ZENECA               | 4 572  | 10 600,00 | 6 225 970     | 3,86 %               |
| Autolus Therapeutics       | 11 128 | 6,44      | 721 903       | 0,45 %               |
| BioArctic AB               | 2 431  | 267,80    | 651 022       | 0,40 %               |
| Boston Scientific Corp     | 8 385  | 57,81     | 4 882 948     | 3,03 %               |
| Bridgebio Pharma Inc       | 3 101  | 40,37     | 1 261 062     | 0,78 %               |
| Cabaletta Bio INC          | 2 917  | 22,70     | 667 019       | 0,41 %               |
| Calliditas Therapeutics AB | 7 262  | 127,10    | 923 000       | 0,57 %               |
| Camurus AB                 | 2 467  | 538,00    | 1 327 246     | 0,82 %               |

| Värdepapper   | Antal   | Kurs     | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|---|---------|----------|--------------------|----------------------|
| Cencora Inc   | 2 131   | 205,38   | 4 408 772          | 2,73 %               |
| Chemometec A/S  | 1 000   | 388,00   | 579 556            | 0,36 %               |
| Cytokinetics Inc  | 1 694   | 83,49    | 1 424 702          | 0,88 %               |
| Daiichi Sankyo Co Ltd   | 10 085  | 3 872,00 | 2 792 910          | 1,73 %               |
| Dexcom Inc  | 2 403   | 124,09   | 3 003 770          | 1,86 %               |
| Edwards Lifesciences Corp   | 2 789   | 76,25    | 2 142 222          | 1,33 %               |
| Egetis Therapeutics AB  | 198 682 | 5,58     | 1 108 646          | 0,69 %               |
| Eli Lilly & Co  | 2 043   | 582,92   | 11 996 468         | 7,44 %               |
| Exact Sciences Corp   | 1 486   | 73,98    | 1 107 412          | 0,69 %               |
| Fusion Pharmaceuticals  | 15 932  | 9,61     | 1 542 303          | 0,96 %               |
| Gilead Sciences Inc   | 5 316   | 81,01    | 4 338 101          | 2,69 %               |
| Immunocore Holdings   | 972     | 68,32    | 668 945            | 0,41 %               |
| Inspire Medical Systems Inc   | 407     | 203,43   | 834 037            | 0,52 %               |
| Intra-Cellular Therapies, Inc   | 1 748   | 71,62    | 1 261 107          | 0,78 %               |
| Ionis Pharmaceuticals   | 3 385   | 50,59    | 1 725 041          | 1,07 %               |
| Iqvia Holdings Inc  | 1 397   | 231,38   | 3 256 104          | 2,02 %               |
| Krystal Biotech, Inc  | 894     | 124,06   | 1 117 237          | 0,69 %               |
| Lonza Group AG  | 312     | 353,70   | 1 322 531          | 0,82 %               |
| Madrigal Pharmaceuticals Inc  | 366     | 231,38   | 853 067            | 0,53 %               |
| Merck & Co. Inc   | 8 510   | 109,02   | 9 345 700          | 5,80 %               |
| Merus N.V.  | 2 907   | 27,50    | 805 293            | 0,50 %               |
| Morphic Holding Inc   | 2 289   | 28,88    | 665 915            | 0,41 %               |
| Neurocrine Biosciences Inc  | 1 445   | 131,76   | 1 917 907          | 1,19 %               |
| Novartis AG   | 6 664   | 84,87    | 6 778 061          | 4,20 %               |
| Novo Nordisk B  | 9 452   | 698,10   | 9 856 092          | 6,11 %               |
| Option Care Health Inc  | 4 772   | 33,69    | 1 619 487          | 1,00 %               |
| Pfizer Inc (USD)  | 5 535   | 28,79    | 1 605 223          | 1,00 %               |
| Prothena Corp Plc   | 1 009   | 36,34    | 369 362            | 0,23 %               |
| Regeneron Pharmaceuticals   | 503     | 878,29   | 4 450 225          | 2,76 %               |
| Sartorius AG Pref   | 647     | 333,20   | 2 401 027          | 1,49 %               |
| ShockWave Medical Inc   | 534     | 190,56   | 1 025 060          | 0,64 %               |
| Stryker Corporation   | 1 640   | 299,46   | 4 947 192          | 3,07 %               |
| Surgical Science Sweden AB  | 3 220   | 182,50   | 587 650            | 0,36 %               |
| Takeda Pharmaceutical Company   | 13 422  | 4 054,00 | 3 891 766          | 2,41 %               |
| Terumo Corporation  | 6 721   | 4 622,00 | 2 221 824          | 1,38 %               |
| Thermo Fisher Scientific Corp   | 1 461   | 530,79   | 7 811 762          | 4,84 %               |
| United Healthgroup Inc  | 2 380   | 526,47   | 12 621 956         | 7,83 %               |
| Vertex Pharmaceuticals Inc  | 1 160   | 406,89   | 4 754 568          | 2,95 %               |
| Zealand Pharma A/S  | 2 671   | 373,20   | 1 488 946          | 0,92 %               |
|   |         |          | <b>156 491 134</b> | <b>97,04 %</b>       |
| <b>Summa noterade aktier</b>  |         |          | <b>156 491 134</b> | <b>97,04 %</b>       |
| <b>Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.</b> |         |          | <b>156 491 134</b> | <b>97,04 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b>  |         |          | <b>4 773 222</b>   | <b>2,96 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>  |         |          | <b>161 264 356</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Impact by Circulus

Avanza Impact by Circulus är en aktiefond vars mål är att investera i globala mikro- och småbolag som bidrar till att uppnå ett eller flera mål för hållbar utveckling (enligt definitionen i Agenda 2030). Detta inkluderar t.ex. förnybar energi, energieffektivitet, hållbar livsmedelsproduktion, utsläppssnåla transporter, bevarande av biologisk mångfald, anpassning till klimatförändringar, rent vatten, finansiell inkludering och ökad tillgång till hälso- och sjukvård.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade sedan fondens start den 10 mars till och med den sista handelsdagen 2023 med 2,0 procent. Fondens jämförelseindex ökade under samma period med 7,4 procent.

Fonden hade en stark utveckling under andra kvartalet. I takt med stigande räntor under sensommaren kom dock optimismen på marknaden att dämpas och oron fortsatte in i oktober. Efter tecken på sjunkande inflation och svagare ekonomisk statistik började FED allt tydligare signalera att räntesänkningar var att vänta under 2024, vilket fick långräntor att falla dramatiskt och världens börser att jubla.

På sektornivå kom fondens övervikt mot kraftförsörjning samt undervikt mot finans att bidra mest negativt till fondens avkastning under perioden relativt index, medan fondens övervikt mot industrisektorn hade störst positiv effekt på avkastningen. Sett till enskilda innehav bidrog fondens övervikt mot bland annat Deveron och Re:Newcell relativt index, som hade en mycket svag utveckling under perioden, negativt till fondens utveckling.

Fondens största innehav inom vatten (SDG 6), H2O Innovation, köptes upp med 66% premie i oktober och blev därmed fondens bästa bidragsgivare under perioden. Därutöver utgjorde fondens innehav i ReposiTrak och Advtech två stora bidragsgivare under perioden.

Den totala fondförmögenheten uppgick vid halvårets slut till 101,2 miljoner kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har enligt sina fondbestämmelser rätt att använda sig av derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning i syfte att effektivisera förvaltningen av tillgångarna i fonden. Under perioden har fonden inte nyttjat denna möjlighet. Fonden har inte lånat ut några värdepapper under 2023.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i marknadsrisk, koncentrationsrisk, likviditetsrisk, motpartsrisk och operativ risk.

Avanza Impact by Circulus är en aktiefond och en investering i fonden är därmed förenat med risk för stora

## Fondfakta

|  |   |
|--|---|
| Fondens startdatum   | 2023-03-10                                |
| Andelsvärde  | 102,01                                    |
| Fondförmögenhet, tkr   | 101 222                                   |
| Utveckling, % <sup>1)</sup>  | 2,01                                      |
| Utv. jämförelseindex, %  | 7,36                                      |
| Kursnotering   | Daglig                                    |
| Inträdesavgift   | Ingen                                     |
| Utträdesavgift   | Ingen                                     |
| Avgifter, % <sup>2)</sup>  | 1,30                                      |
| Förvaltningsavgift, %  | 1,30                                      |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 1,50                                      |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,40                                      |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                           |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning             |
| Förvaltare   | Joakim By, Simon Park, Christofer Halldin |
| Organisationsnummer  | 5156032723                                |
| <small>1) Sedan fondstart.<br/>2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |   |

| Fondens 5 största innehav    | Exponering, tkr | % av fond |
|------------------------------|-----------------|-----------|
| Advtech LTD                  | 4 342           | 4,29 %    |
| 5N Plus Inc                  | 3 959           | 3,91 %    |
| Hikma Pharmaceuticals        | 3 954           | 3,91 %    |
| Altus Power Inc              | 3 713           | 3,67 %    |
| Graphic Packaging Holding Co | 3 542           | 3,50 %    |

kurssvängningar (marknadsrisk).

Eftersom fondens placeringar är koncentrerade till en enskild bransch och ett mindre antal aktier så har fonden normalt något högre risk än för fonder med placeringar i flera länder med fler underliggande bolags aktier (koncentrationsrisk).

Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna, kan det finnas en risk att inte kunna ta ut medel ur fonden inom utsatt tid (likviditetsrisk).

Vidare får fonden investera i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Avanza Impact by Circulus jämförelseindex är Morningstar DM sml TME NR SEK. Indexet är relevant då det representerar det placeringsuniversum fonden placerar i.

Aktiv risk beräknas på 24 månaders historik. Avanza Impact by Circulus har inte tillräckligt lång historik för att redovisa aktiv risk.

### Övrigt

Fonden startade och bytte förvaringsinstitut under året.

### Resultaträkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Intäkter</b>                                    | <b>2023</b>   | <b>2022</b> |
|--|---------------|-------------|
| Värdeförändring på överlåtbara värdepapper (Not 1) | 1 614         | -           |
| Utdelningar  | 588           | -           |
| Valutakursvinster och -förluster netto             | -53           | -           |
| Övriga finansiella intäkter                        | 83            | -           |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b>          | <b>2 232</b>  | <b>-</b>    |
| <b>Kostnader</b>                                   | <b>2023</b>   | <b>2022</b> |
| Förvaltningskostnader                              | -975          | -           |
| Övriga finansiella kostnader                       | -62           | -           |
| Övriga kostnader                                   | -157          | -           |
| <b>Summa kostnader</b>                             | <b>-1 194</b> | <b>-</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                              | <b>1 038</b>  | <b>-</b>    |

1) Fonden startade 2023



## Balansräkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Överlåtbara värdepapper  | 100 352           | -                 |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>100 352</b>    | <b>-</b>          |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 1 196             | -                 |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>101 548</b>    | <b>-</b>          |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 326               | -                 |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>326</b>        | <b>-</b>          |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>101 222</b>    | <b>-</b>          |

1) Fonden startade 2023

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>  | <b>2022</b> |
|--|--------------|-------------|
| <b>Not 1</b>   |              |             |
| <b>Värdetförändring överlåtbara värdepapper</b>          |              |             |
| Realisationsvinster                                      | 4 269        | -           |
| Realisationsförluster                                    | -2 604       | -           |
| Orealiserade vinster/förluster                           | -51          | -           |
| <b>Summa värdetförändring på överlåtbara värdepapper</b> | <b>1 614</b> | <b>-</b>    |

|   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Andelsutgivning                           | 141 723           | -                 |
| Andelsinlösen                             | -41 539           | -                 |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 1 038             | -                 |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>101 222</b>    | <b>-</b>          |

## Fondens utveckling

|                          | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> | <b>2021-12-31</b> | <b>2020-12-31</b> | <b>2019-12-31</b> |
|--------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 101 222           |                   |                   |                   |                   |
| Andelsvärde              | 102,01            |                   |                   |                   |                   |
| Antal utestående andelar | 992 287           |                   |                   |                   |                   |
| Utdelning kr/andel       | -                 |                   |                   |                   |                   |
| Totalavkastning, %       | 2,01              |                   |                   |                   |                   |
| Jämförelseindex, %       | 7,36              |                   |                   |                   |                   |
| Aktiv risk (2 år), %     | -                 |                   |                   |                   |                   |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | <b>Förvaltningskostnad, kr</b> | <b>Marknadsvärde</b> |
|-------------------------------|--------------------------------|----------------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 4,81                           | 1 012,96             |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 98,93                          | 10 241,97            |

## Övrigt

|  | <b>2023</b> |
|--|-------------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,40        |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00        |
| Förvaltningsavgift, %                  | 1,30        |
| Avgifter, % 1)                         | 1,30        |
| Transaktionskostnader, tkr             | 218,21      |
| Transaktionskostnader, %               | 0,13        |
| Analyskostnader, tkr                   | 0           |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.

99,14 %

| Värdepapper                          | Antal   | Kurs     | Marknadsvärde     | Andel av förmögenhet |
|--------------------------------------|---------|----------|-------------------|----------------------|
| <b>Noterade aktier</b>               |         |          |                   |                      |
| <b>Material</b>                      |         |          |                   |                      |
| 5N Plus Inc                          | 137 465 | 3,78     | 3 958 552         | 3,91 %               |
| Advanced Drainage Systems Inc        | 357     | 140,64   | 505 770           | 0,50 %               |
| Altus Power Inc                      | 53 972  | 6,83     | 3 713 345         | 3,67 %               |
| ARCADIUM LITHIUM PLC                 | 10 628  | 11,21    | 818 860           | 0,81 %               |
| Bioceres Crop Solutions Corp         | 19 087  | 13,73    | 2 639 881         | 2,61 %               |
| Biokraft International               | 67 260  | 20,35    | 1 368 741         | 1,35 %               |
| Global Water Resources Inc           | 25 432  | 13,08    | 3 350 922         | 3,31 %               |
| Graphic Packaging Holding Co         | 14 263  | 24,65    | 3 541 636         | 3,50 %               |
| Pure Cycle Corp                      | 20 950  | 10,47    | 2 209 565         | 2,18 %               |
| Toyo Gosei Co LTD                    | 1 623   | 8 340,00 | 968 122           | 0,96 %               |
| Trex Company Inc                     | 1 916   | 82,79    | 1 597 900         | 1,58 %               |
|                                      |         |          | <b>24 673 293</b> | <b>24,38 %</b>       |
| <b>Hälsovård</b>                     |         |          |                   |                      |
| Acadia Healthcare Company Inc        | 1 262   | 77,76    | 988 534           | 0,98 %               |
| Calliditas Therapeutics AB           | 15 061  | 127,10   | 1 914 253         | 1,89 %               |
| Chemed Corp                          | 87      | 584,75   | 512 467           | 0,51 %               |
| Hikma Pharmaceuticals                | 17 206  | 1 789,00 | 3 954 442         | 3,91 %               |
| Neogen Corp                          | 10 828  | 20,11    | 2 193 494         | 2,17 %               |
| PTC Therapeutics Inc                 | 933     | 27,56    | 259 022           | 0,26 %               |
| Sosei Group Corp                     | 8 467   | 1 421,00 | 860 537           | 0,85 %               |
|                                      |         |          | <b>10 682 749</b> | <b>10,55 %</b>       |
| <b>Sällanköpsvaror och -tjänster</b> |         |          |                   |                      |
| Advtech LTD                          | 321 009 | 2 454,00 | 4 342 112         | 4,29 %               |
| Anima Holding                        | 352 834 | 4,46     | 3 271 597         | 3,23 %               |
| Bright Horizons Family Solutions Inc | 2 979   | 94,24    | 2 828 016         | 2,79 %               |
| Cavco Industries Inc                 | 309     | 346,62   | 1 078 917         | 1,07 %               |
| Darling Ingredients Inc              | 3 660   | 49,84    | 1 837 533         | 1,82 %               |
| Grand Canyon Education Inc           | 1 976   | 132,04   | 2 628 261         | 2,60 %               |
| Re:NewCell                           | 29 500  | 7,61     | 224 348           | 0,22 %               |
| Spinnova                             | 7 627   | 2,40     | 203 445           | 0,20 %               |
|                                      |         |          | <b>16 414 229</b> | <b>16,22 %</b>       |
| <b>Industrivaror och -tjänster</b>   |         |          |                   |                      |
| Alarm.com Holdings Inc               | 1 353   | 64,62    | 880 726           | 0,87 %               |
| Alfen                                | 1 766   | 60,28    | 1 185 637         | 1,17 %               |
| Clean Harbors Inc                    | 1 040   | 174,51   | 1 828 225         | 1,81 %               |
| Core & Main                          | 3 810   | 40,41    | 1 550 922         | 1,53 %               |
| Cryoport Inc                         | 8 281   | 15,49    | 1 292 142         | 1,28 %               |
| Energy Recovery Inc                  | 1 815   | 18,84    | 344 456           | 0,34 %               |
| Gates Industrial Corporation         | 12 899  | 13,42    | 1 743 752         | 1,72 %               |
| GXO Logistics Inc                    | 4 038   | 61,16    | 2 487 768         | 2,46 %               |
| Kadant Inc                           | 427     | 280,31   | 1 205 709         | 1,19 %               |
| Kurita Water Industries              | 5 187   | 5 520,00 | 2 047 864         | 2,02 %               |
| Montrose Environmental Group Inc     | 4 388   | 32,13    | 1 420 213         | 1,40 %               |
| Oxford Instruments                   | 8 509   | 2 295,00 | 2 508 743         | 2,48 %               |
| Quest Resource Holding Corp          | 23 714  | 7,33     | 1 750 995         | 1,73 %               |

| Värdepapper   | Antal     | Kurs   | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|---|-----------|--------|--------------------|----------------------|
| Scandinavian Enviro Systems   | 850 000   | 1,80   | 1 528 300          | 1,51 %               |
| Shimmick Corp   | 20 000    | 6,60   | 1 329 689          | 1,31 %               |
| Tetra Tech Inc  | 823       | 166,93 | 1 383 918          | 1,37 %               |
| Volution Group  | 55 722    | 433,60 | 3 103 923          | 3,07 %               |
| Willscott Mobile Mini   | 5 716     | 44,50  | 2 562 290          | 2,53 %               |
|   |           |        | <b>30 155 271</b>  | <b>29,79 %</b>       |
| <b>Informationsteknik</b>   |           |        |                    |                      |
| Descartes Systems Group Inc   | 1 426     | 111,33 | 1 209 439          | 1,19 %               |
| Deveron Corp  | 1 122 635 | 0,19   | 1 582 205          | 1,56 %               |
| Doximity Inc  | 6 751     | 28,04  | 1 906 875          | 1,88 %               |
| Freemelt Holding  | 313 269   | 6,84   | 2 142 760          | 2,12 %               |
| Maximus Inc   | 4 176     | 83,86  | 3 527 698          | 3,49 %               |
| Power Integrations Inc  | 1 177     | 82,11  | 973 528            | 0,96 %               |
| REPOSITRAK INC  | 32 525    | 10,01  | 3 279 650          | 3,24 %               |
| Verra Mobility Corp   | 9 093     | 23,03  | 2 109 489          | 2,08 %               |
|   |           |        | <b>16 731 644</b>  | <b>16,53 %</b>       |
| <b>Finans och fastighet</b>   |           |        |                    |                      |
| Palomar Holdings Inc  | 3 031     | 55,50  | 1 694 552          | 1,67 %               |
|   |           |        | <b>1 694 552</b>   | <b>1,67 %</b>        |
| <b>Summa noterade aktier</b>  |           |        | <b>100 351 738</b> | <b>99,14 %</b>       |
| <b>Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.</b> |           |        | <b>100 351 738</b> | <b>99,14 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b>  |           |        | <b>870 159</b>     | <b>0,86 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>  |           |        | <b>101 221 897</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

# Avanza Ränta Global

Avanza Ränta Global är en matarfond som placerar sina medel i mottagarfonden Captor Global Fixed Income och dess andelsklass A (Mottagarfonden). Avanza Ränta Globals medel ska placeras till minst 85 procent av Avanza Ränta Global värde i fondandelar i Mottagarfonden. 15 procent av Avanza Ränta Globals medel får placeras i likvida medel.

## Förvaltningsberättelse

Fonden startades den 8:e december 2024, fram till årets slut ökade fondens andelsvärde med 2,5 procent, vilket var i linje med fondens mottagarfond Captor Global Fixed Income. Vid årets slut var fondförmögenheten 176,3 miljoner kronor.

Sedan fondens start har räntor fortsatt att falla drivet av övertygelsen att räntor kommer att sänkas av centralbanker i USA och Europa under 2024. Svensk fyraårig swapränta sjönk under perioden 8:e december till årsskiftet med 30 räntebaspunkter från 2,76% till 2,46%. De fallande räntorna har medfört lägre riskpremier med medföljande lägre creditspreadar. IG handlades i slutet av månaden på strax under 60 baspunkter, en kompression med ca 8 kreditbaspunkter sedan fonden lanserades. HY i Europa stängde på 314 baspunkter och USA på 354 baspunkter, en nedgång med i snitt nästan 50 kreditbaspunkter.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får inte använda derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Avanza Ränta Global placerar sina medel i Mottagarfonden vilket gör att matarfondens risker i hög utsträckning är förknippade med mottagarfondens risker. Mottagarfonden placerar i räntebärande värdepapper som generellt kännetecknas av lägre risk än aktiemarknaden, men högre än i en traditionell räntefond. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk.

Mottagarfonden får investera i derivat vilket kan innebära en ökad marknads- och motpartsrisk i fonden.

Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk, sådan risk är mest påtaglig i innehav med låg omsättning.

## Aktivitetsgrad

Fondens målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. Förvaltningen bedrivs genom att fondens medel placeras i mottagarfonden. Då förvaltningen av Fonden ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden. För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.captor.se](http://www.captor.se).

## Fondfakta

|   |   |
|---|---|
| Fondens startdatum                                  | 2023-12-08  |
| Andelsvärde   | 102,54  |
| Fondförmögenhet, tkr                                | 176 296   |
| Utveckling, % <sup>1)</sup>                         | 2,54  |
| Kursnotering  | Daglig  |
| Inträdesavgift                                      | Ingen   |
| Utträdesavgift                                      | Ingen   |
| Avgifter, % <sup>2)</sup>                           | 0,40  |
| Förvaltningsavgift, %                               | 0,20  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %               | 1,00  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, % | 0,60  |
| Omsättningshastighet, ggr                           | 1,32  |
| Riskbedömningsmetod                                 | Åtagandemetoden                                   |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning                     |
| Förvaltare  | Daniel Karlgren, William Sjöberg (mottagarfonden) |
| Organisationsnummer                                 | 515603-3176                                       |

1) Sedan fondstart.

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

## Övrigt

Fonden startade under året.

För information om mottagarfondens halvårsredogörelse och årsberättelse, se [www.captor.se](http://www.captor.se).

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                            | <b>2023</b>  | <b>2022</b> |
|--|--------------|-------------|
| Värdetförändring på fondandelar (Not 1)    | 2 981        | -           |
| Övriga finansiella intäkter                | 49           | -           |
| <b>Summa intäkter och värdetförändring</b> | <b>3 031</b> | <b>-</b>    |
| <b>Kostnader</b>                           | <b>2023</b>  | <b>2022</b> |
| Förvaltningskostnader                      | -18          | -           |
| Övriga finansiella kostnader               | -4           | -           |
| <b>Summa kostnader</b>                     | <b>-22</b>   | <b>-</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                      | <b>3 009</b> | <b>-</b>    |

## Balansräkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 176 235           | -                 |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>176 235</b>    | <b>-</b>          |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 58                | -                 |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 24                | -                 |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>176 318</b>    | <b>-</b>          |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 22                | -                 |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>22</b>         | <b>-</b>          |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>176 296</b>    | <b>-</b>          |

1) Fonden startade 2023

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>       | <b>2022</b>       |
|--|-------------------|-------------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                   |                   |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                   |                   |
| Orealiserade vinster/förluster               | 2 981             | -                 |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>2 981</b>      | <b>-</b>          |
|  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| <b>Not 2</b>                                 |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>              |                   |                   |
| Andelsutgivning                              | 180 800           | -                 |
| Andelsinlösen                                | -7 513            | -                 |
| Årets resultat enligt resultaträkning        | 3 009             | -                 |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b>    | <b>176 296</b>    | <b>-</b>          |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 176 296    |            |            |            |            |
| Andelsvärde              | 102,54     |            |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 1 719 350  |            |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          |            |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | 2,54       |            |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          |            |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          |            |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,01                    | 102,54        |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 1,29                    | 10 254,00     |

## Övrigt

|  | 2023 |
|--|------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 1,32 |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00 |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,20 |
| Avgifter, % <sup>1)2)</sup>            | 0,40 |
| Transaktionskostnader, tkr             | 4,20 |
| Transaktionskostnader, %               | 0,00 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0    |

1) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 19 603 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |         |        |                    | 99,97 %              |
|--|---------|--------|--------------------|----------------------|
| Värdepapper                                  | Antal   | Kurs   | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                           |         |        |                    |                      |
| <b>Räntefonder</b>                           |         |        |                    |                      |
| Captor Global Fixed Income A                 | 859 513 | 205,04 | 176 235 340        | 99,97 %              |
|  |         |        | <b>176 235 340</b> | <b>99,97 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |         |        | <b>176 235 340</b> | <b>99,97 %</b>       |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |         |        | <b>176 235 340</b> | <b>99,97 %</b>       |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |         |        | <b>60 607</b>      | <b>0,03 %</b>        |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |         |        | <b>176 295 947</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.



# Avanza Ränta Kort

Avanza Ränta Kort är en matarfond som placerar sina medel i mottagarfonden Captor Perenne Short Term Bond (Mottagarfonden). Avanza Ränta Korts medel ska placeras till minst 85 procent av Avanza Ränta Korts värde i fondandelar i Mottagarfondens andelsklass A.15 procent av Ränta Kort medel får placeras i likvida medel.

## Förvaltningsberättelse

Fonden startades 14e december 2023, sedan dess ökade fondens andelsvärde till årets slut med 0,2 procent, i linje med fondens mottagarfond Captor Perenne Short Term Bond. Vid årets slut var fondförmögenheten 50,1 miljoner kronor.

Sedan fondens start har räntor fortsatt att falla drivet av övertygelsen att räntor kommer att sänkas av centralbanker i USA och Europa under 2024. Det har medfört lägre riskpremier med medföljande lägre bostadsobligationsspreadar. Korta räntefixingar har handlat relativt konstant och antalet i räntebanan inprisade sänkningar under det närmaste året har även det varit konstant. Förväntansbilden vid årsskiftet var en styrränta på ca 2,5% i slutet av 2024.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får inte använda derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Avanza Ränta Kort placerar sina medel i Mottagarfonden vilket gör att matarfondens risker i hög utsträckning är förknippade med mottagarfondens risker. Mottagarfonden placerar i räntebärande värdepapper som generellt kännetecknas av lägre risk än aktiemarknaden, men högre än i en traditionell räntefond. Fondens räntebärande innehav är behäftade med risk i form av bland annat kreditrisk samt ränterisk.

Mottagarfonden får investera i derivat vilket kan innebära en ökad marknads- och motpartsrisk i fonden.

Fonden är även exponerad mot likviditetsrisk, sådan risk är mest påtaglig i innehav med låg omsättning.

## Aktivitetsgrad

Fondens målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. Förvaltningen bedrivs genom att fondens medel placeras i mottagarfonden. Då förvaltningen av Fonden ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden. För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.captor.se](http://www.captor.se).

## Övrigt

Fonden startade under året.

För information om mottagarfondens halvårsredogörelse och årsberättelse, se [www.captor.se](http://www.captor.se).

## Fondfakta

|   |   |
|---|---|
| Fondens startdatum                                  | 2023-12-15  |
| Andelsvärde   | 100,19  |
| Fondförmögenhet, tkr                                | 50 112  |
| Utveckling, % <sup>1)</sup>                         | 0,19  |
| Kursnotering  | Daglig  |
| Inträdesavgift                                      | Ingen   |
| Utträdesavgift                                      | Ingen   |
| Avgifter, % <sup>2)</sup>                           | 0,07  |
| Förvaltningsavgift, %                               | 0,03  |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %               | 0,25  |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, % | 0,20  |
| Omsättningshastighet, ggr                           | 1,56  |
| Riskbedömningsmetod                                 | Åtagandemetoden                                   |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning                     |
| Förvaltare  | Daniel Karlgren, William Sjöberg (mottagarfonden) |
| Organisationsnummer                                 | 515603-3168                                       |

1) Sedan fondstart.

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                            | <b>2023</b> | <b>2022</b> |
|--|-------------|-------------|
| Värdetförändring på fondandelar (Not 1)    | 61          | -           |
| Övriga finansiella intäkter                | 10          | -           |
| <b>Summa intäkter och värdetförändring</b> | <b>71</b>   | <b>-</b>    |
| <b>Kostnader</b>                           | <b>2023</b> | <b>2022</b> |
| Övriga finansiella kostnader               | -3          | -           |
| <b>Summa kostnader</b>                     | <b>-3</b>   | <b>-</b>    |
| <b>Årets resultat</b>                      | <b>68</b>   | <b>-</b>    |

## Balansräkning, tkr <sup>1)</sup>

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 50 086            | -                 |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>50 086</b>     | <b>-</b>          |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 28                | -                 |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 1                 | -                 |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>50 115</b>     | <b>-</b>          |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 3                 | -                 |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>3</b>          | <b>-</b>          |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>50 112</b>     | <b>-</b>          |

1) Fonden startade 2023

## Tilläggsupplysningar, tkr

|  | <b>2023</b>       | <b>2022</b>       |
|--|-------------------|-------------------|
| <b>Not 1</b>                                 |                   |                   |
| <b>Värdetförändring fonder</b>               |                   |                   |
| Orealiserade vinster/förluster               | 61                | -                 |
| <b>Summa värdetförändring på fondandelar</b> | <b>61</b>         | <b>-</b>          |
|  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| <b>Not 2</b>                                 |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>              |                   |                   |
| Andelsutgivning                              | 51 952            | -                 |
| Andelsinlösen                                | -1 907            | -                 |
| Årets resultat enligt resultaträkning        | 68                | -                 |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b>    | <b>50 112</b>     | <b>-</b>          |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 50 112     |            |            |            |            |
| Andelsvärde              | 100,19     |            |            |            |            |
| Antal utestående andelar | 500 181    |            |            |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          |            |            |            |            |
| Totalavkastning, %       | 0,19       |            |            |            |            |
| Jämförelseindex, %       | -          |            |            |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          |            |            |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,00                    | 100,17        |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 0,14                    | 10 017,00     |

## Övrigt

|  | 2023 |
|--|------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 1,56 |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00 |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,03 |
| Avgifter, % <sup>1)2)</sup>            | 0,07 |
| Transaktionskostnader, tkr             | 2,70 |
| Transaktionskostnader, %               | 0,01 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0    |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

2) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 518 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument         |         |        |                   | 99,95 %              |
|---------------------------------------|---------|--------|-------------------|----------------------|
| Värdepapper                           | Antal   | Kurs   | Marknadsvärde     | Andel av förmögenhet |
| Fondandelar                           |         |        |                   |                      |
| <b>Räntefonder</b>                    |         |        |                   |                      |
| Captor Perenne Short Term Bond A      | 249 988 | 200,35 | 50 085 523        | 99,95 %              |
|                                       |         |        | <b>50 085 523</b> | <b>99,95 %</b>       |
| <b>Summa fondandelar</b>              |         |        | <b>50 085 523</b> | <b>99,95 %</b>       |
| Övriga finansiella instrument         |         |        | 50 085 523        | 99,95 %              |
| Övriga tillgångar och skulder (netto) |         |        | 26 302            | 0,05 %               |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                |         |        | <b>50 111 825</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

Fonden får inte använda derivatinstrument.

# Avanza Småbolag by Skoglund

Fonden är en matarfond som placerar sina medel i mottagarfonden FE Småbolag Sverige A. Mottagarfonden är en aktivt förvalttad aktiefond som investerar i små och medelstora bolag på den svenska marknaden. Mottagarfonden kan placera i alla sektorer men investerar inte i bolag utanför Norden. Mottagarfonden har som mål att långsiktigt, över minst fem år, överträffa sitt jämförelseindex.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 2,9 procent, vilket var i linje med mottagarfonden under samma period. Avanza Småbolag by Skoglund har under hela perioden varit i det närmaste fullt investerad i mottagarfonden.

Börsåret 2023 blev ett händelserikt år med inledningsvis positiva tongångar och optimism, men som sedan kom att präglas av konjunktur- och ränteoro samt ökade geopolitiska spänningar. Under de första kvartalen stod de amerikanska teknikjättarna för att vara dragkraften bakom uppgången för globala bolag. Det var först under den senare delen av året, när centralbankerna började pausa sina räntehöjningar och marknaden fick förhoppningar om att räntetoppen var nådd, som riskviljan för mindre- och mer räntekänsliga bolag ökade.

Fondens största bidragsgivare under året var Trelleborg, följt av Mycronic och Bufab. De största negativa bidragen under året kom från Hexatronic, Embracer och Bewi ASA.

Den totala fondförmögenheten minskade under året i Avanza Småbolag by Skoglund från 1,7 till 1,4 miljarder kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får inte använda derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i motpartsrisk, marknadsrisk, likviditet- och valutarisk samt operativ risk.

Avanza Småbolag by Skoglund placerar sina medel i mottagarfonden vilket ger en motpartrisk för Fonden gentemot mottagarfonden. Mottagarfonden investerar även i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Då mottagarfonden investerar i aktier och derivat med exponering mot aktiemarknader är en investering i Avanza Småbolag by Skoglund förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk).

Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna kan det i de underliggande aktieinnehaven finnas risk för att inte kunna sälja innehaven i utsatt tid (likviditetsrisk) vilket då på motsvarande vis påverkar försäljningen av mottagarfondens andelar inom utsatt tid (likviditetsrisk).

De aktier som ingår i mottagarfonden kan i undantagsfall vara noterade i andra valutor än SEK vilka då också förändras i förhållande till den svenska kronan och därmed påverkar utvecklingen för de underliggande tillgångarna i Avanza Småbolag by Skoglund (valutarisk).

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller

## Fondfakta

|  |                                   |
|--|-----------------------------------|
| Fondens startdatum   | 2020-11-26                        |
| Andelsvärde  | 108,86                            |
| Fondförmögenhet, tkr   | 1 427 458                         |
| Utveckling, %  | 2,87                              |
| Kursnotering   | Daglig                            |
| Inträdesavgift   | Ingen                             |
| Utträdesavgift   | Ingen                             |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>  | 1,17                              |
| Förvaltningsavgift, %  | 0,60                              |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %  | 0,75                              |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, %  | 1,50                              |
| Omsättningshastighet, ggr  | 0,03                              |
| Riskbedömningsmetod  | Åtagandemetoden                   |
| Utdelning  | Fonden lämnar ingen utdelning     |
| Förvaltare   | Fredrik Skoglund (mottagarfonden) |
| Organisationsnummer  | 515603-1477                       |
| <small>1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %</small> |                                   |

rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Fondens målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. För att uppnå detta placeras fondens medel i mottagarfonden. Då förvaltningen av Fonden ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden. För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.fcg.se](http://www.fcg.se).

### Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

Information om mottagarfondens årsberättelse och halvårsredogörelse finns på [www.fcg.se](http://www.fcg.se).

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>   | <b>2022</b>     |
|---|---------------|-----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 33 776        | -952 443        |
| Övriga finansiella intäkter               | 14 784        | 19 528          |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>48 559</b> | <b>-932 915</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>   | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -9 347        | -12 215         |
| Övriga finansiella kostnader              | -26           | -46             |
| Övriga kostnader                          | -             | -14             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-9 373</b> | <b>-12 275</b>  |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>39 186</b> | <b>-945 190</b> |

### Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 1 426 295         | 1 719 441         |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>1 426 295</b>  | <b>1 719 441</b>  |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 199               | 397               |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 2 964             | 4 033             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>1 429 457</b>  | <b>1 723 871</b>  |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 1 999             | 2 598             |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>1 999</b>      | <b>2 598</b>      |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>1 427 458</b>  | <b>1 721 273</b>  |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|   | 2023          | 2022            |
|---|---------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                |               |                 |
| <b>Värdeförändring fonder</b>               |               |                 |
| Realisationsvinster                         | -             | 30 641          |
| Realisationsförluster                       | -37 894       | -18 666         |
| Orealiserade vinster/förluster              | 71 670        | -964 418        |
| <b>Summa värdeförändring på fondandelar</b> | <b>33 776</b> | <b>-952 443</b> |

|   | 2023-12-31       | 2022-12-31       |
|---|------------------|------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                  |                  |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                  |                  |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 1 721 273        | 2 930 135        |
| Andelsutgivning                           | 235 198          | 709 101          |
| Andelsinlösen                             | -568 198         | -972 790         |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 39 186           | -945 190         |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>1 427 458</b> | <b>1 721 273</b> |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 1 427 458  | 1 721 273  | 2 930 135  | 1 263 244  |            |
| Andelsvärde              | 108,86     | 105,82     | 156,73     | 110,02     |            |
| Antal utestående andelar | 13 113 053 | 16 265 379 | 18 695 222 | 11 481 528 |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          |            |
| Totalavkastning, %       | 2,87       | -32,48     | 42,46      | 10,02      |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          | -          | -          |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          | -          | -          |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 3,71                    | 1 348,39      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 59,54                   | 10 287,28     |

## Övrigt

|  | 2023   |
|--|--------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,03   |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00   |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,60   |
| Avgifter, % <sup>1)2)</sup>            | 1,17   |
| Transaktionskostnader, tkr             | 25,88  |
| Transaktionskostnader, % <sup>3)</sup> | 0,01   |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 25,09  |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | -16,66 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0      |

1) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 17 705 656 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

3) Transaktionskostnader tillkommer i mottagarfonden. Mottagarfondens årsberättelse finns att tillgå på [www.fcgfonder.se](http://www.fcgfonder.se).

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda

som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument         |            |        |               | 99,92 %              |
|---------------------------------------|------------|--------|---------------|----------------------|
|                                       | Antal      | Kurs   | Marknadsvärde | Andel av förmögenhet |
| Värdepapper                           |            |        |               |                      |
| Fondandelar                           |            |        |               |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                    |            |        |               |                      |
| FE Småbolag Sverige                   | 12 954 474 | 110,10 | 1 426 294 825 | 99,92 %              |
|                                       |            |        | 1 426 294 825 | 99,92 %              |
| <b>Summa fondandelar</b>              |            |        | 1 426 294 825 | 99,92 %              |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>  |            |        | 1 426 294 825 | 99,92 %              |
| Övriga tillgångar och skulder (netto) |            |        | 1 163 672     | 0,08 %               |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                |            |        | 1 427 458 497 | 100,00 %             |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.



# Avanza Sverige

Avanza Sverige är en indexnära aktiefond med inriktning mot Sverige. Målsättningen är att ge en bred exponering mot den svenska aktiemarknaden genom att fondens medel placeras i både stora och små bolag som handlas på en reglerad marknad i Sverige. Indexet Morningstar® Sweden Sustainability Select 70 Index beaktar miljö-, sociala och bolagsstyrningsaspekter (ESG).

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 10,3 procent, vilket var i linje med jämförelseindexet Morningstar® Sweden Sustainability Select 70 som ökade med 10,4 procent under samma period.

Börsåret 2023 präglades av osäkerhet kring inflationen, bankoro och kreditåtstramningar från världens centralbanker.

Finansiella tjänster, industrivaror och sällanköpsvaror utgjorde de tre sektorer som bidrog mest positivt till fondens utveckling under året, medan informationsteknik och allmännyttan bidrog mest negativt. Fondens tre bästa bidragsgivare under året bland enskilda aktier var Hennes & Mauritz, Assa Abloy och Atlas Copco och medan Viaplay, NIBE och Embracer Group utgjorde de tre sämsta bidragsgivarna.

Den totala fondförmögenheten ökade under året i Avanza Sverige från 1,4 till 1,9 miljarder kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får enligt sina fondbestämmelser handla med derivat som ett led i placeringsinriktningen. Under 2023 har fonden inte utnyttjat denna möjlighet.

Högsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Lägsta hävstång under perioden 0,0 procent.

Genomsnittlig hävstång under perioden 0,0 procent.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i marknadsrisk, koncentrationsrisk, likviditetsrisk, motpartsrisk och operativ risk. Avanza Sverige är en aktiefond och en investering i fonden är därmed förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk). Eftersom fondens placeringar är koncentrerade till ett enskilt land och cirka 70 bolagsaktier så har fonden normalt något högre risk än för fonder med placeringar i flera länder med fler underliggande bolags aktier (koncentrationsrisk). Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna, kan det finnas en risk att inte kunna ta ut medel ur fonden inom utsatt tid (likviditetsrisk). Vidare får fonden investera i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk. Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

## Aktivitetsgrad

Avanza Sverige är en indexnära fond vars jämförelseindex är Morningstar Sweden Sustainable Select 70. Indexet är relevant då det representerar det placeringsuniversum Avanza Sverige placerar i. För att följa indexets utveckling

## Fondfakta

|   |                               |
|---|-------------------------------|
| Fondens startdatum  | 2021-09-10                    |
| Andelsvärde   | 82,74                         |
| Fondförmögenhet, tkr  | 1 883 388                     |
| Utveckling, %   | 10,31                         |
| Utv. jämförelseindex, %   | 10,43                         |
| Kursnotering  | Daglig                        |
| Inträdesavgift  | Ingen                         |
| Utträdesavgift  | Ingen                         |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>   | 0,15                          |
| Förvaltningsavgift, %   | 0,15                          |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %                                       | 0,20                          |
| Omsättningshastighet, ggr   | 0,41                          |
| Riskbedömningsmetod   | Åtagandemetoden               |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning |
| Förvaltare  | Peter Stengård                |
| Organisationsnummer   | 515603-1311                   |
| 1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, % |                               |

| Fondens 5 största innehav | Exponering, tkr | % av fond |
|---------------------------|-----------------|-----------|
| EQT                       | 72 646          | 3,86 %    |
| HEXAGON B                 | 70 827          | 3,76 %    |
| ASSA ABLOY B              | 67 314          | 3,57 %    |
| NDA SE                    | 67 293          | 3,57 %    |
| SHB A                     | 66 706          | 3,54 %    |

investerar Avanza Sverige huvudsakligen i de aktier som ingår i index.

En indexnära fond ska ha en relativt låg aktiv risk vilket indikerar hur väl fonden följer jämförelseindex. Vissa omständigheter såsom rebalanseringar, företagshändelser samt kundflöden kan ge upphov till avvikelser mellan en indexnära fond och dess jämförelseindex.

Avanza Sverige är passivt förvaltd och har avvikit från jämförelseindex i förväntad omfattning sett till den senaste 24-månadersperioden, som redovisas för år 2023.

För information om aktivitetsgrad se tabell under "Fondens utveckling " nedan.

## Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

## Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                                    | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|--|----------------|-----------------|
| Värdeförändring på överlåtbara värdepapper (Not 1) | 135 963        | -490 637        |
| Utdelningar  | 40 430         | 36 112          |
| Övriga finansiella intäkter                        | 131            | 31              |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b>          | <b>176 524</b> | <b>-454 494</b> |
| <b>Kostnader</b>                                   | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                              | -2 363         | -2 005          |
| Övriga finansiella kostnader                       | -87            | -184            |
| Övriga kostnader                                   | -157           | -136            |
| <b>Summa kostnader</b>                             | <b>-2 607</b>  | <b>-2 325</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                              | <b>173 917</b> | <b>-456 820</b> |

## Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Överlåtbara värdepapper  | 1 880 286         | 1 417 381         |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>1 880 286</b>  | <b>1 417 381</b>  |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 3 757             | 2 966             |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>1 884 043</b>  | <b>1 420 348</b>  |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 655               | 560               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>655</b>        | <b>560</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>1 883 388</b>  | <b>1 419 788</b>  |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|   | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|---|----------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>  |                |                 |
| <b>Värdeförändring överlåtbara värdepapper</b>          |                |                 |
| Realisationsvinster                                     | 49 218         | 18 552          |
| Realisationsförluster                                   | -155 511       | -121 794        |
| Orealiserade vinster/förluster                          | 242 256        | -387 396        |
| <b>Summa värdeförändring på överlåtbara värdepapper</b> | <b>135 963</b> | <b>-490 637</b> |

|   | 2023-12-31       | 2022-12-31       |
|---|------------------|------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                  |                  |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                  |                  |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 1 419 788        | 1 520 138        |
| Andelsutgivning                           | 607 571          | 771 360          |
| Andelsinlösen                             | -317 888         | -414 891         |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 173 917          | -456 820         |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>1 883 388</b> | <b>1 419 788</b> |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 1 883 388  | 1 419 789  | 1 520 138  |            |            |
| Andelsvärde              | 82,74      | 75,01      | 105,01     |            |            |
| Antal utestående andelar | 22 763 882 | 18 929 028 | 14 476 033 |            |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          |            |            |
| Totalavkastning, %       | 10,31      | -28,57     | 5,01       |            |            |
| Jämförelseindex, %       | 10,43      | -28,48     | 5,05       |            |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | 0,49       | -          | -          |            |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,95                    | 1 393,80      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 15,38                   | 11 030,53     |

## Övrigt

|  | 2023   |
|--|--------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,41   |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00   |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,15   |
| Avgifter, % 1)                         | 0,15   |
| Transaktionskostnader, tkr             | 244,05 |
| Transaktionskostnader, %               | 0,02   |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 23,94  |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 24,02  |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | -11,23 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0      |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningsystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicy vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra

och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.

99,84 %

| Värdepapper                        | Antal   | Kurs   | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|------------------------------------|---------|--------|--------------------|----------------------|
| <b>Noterade aktier</b>             |         |        |                    |                      |
| <b>Hälsovård</b>                   |         |        |                    |                      |
| ADDLIFE AB B                       | 137 754 | 109,40 | 15 070 288         | 0,80 %               |
| Biotage AB                         | 106 825 | 133,70 | 14 282 503         | 0,76 %               |
| Elekta B                           | 302 023 | 82,32  | 24 862 533         | 1,32 %               |
| SECTRA B                           | 130 672 | 180,26 | 23 554 935         | 1,25 %               |
| Xvivo Perfusion                    | 44 766  | 329,50 | 14 750 397         | 0,78 %               |
|                                    |         |        | <b>92 520 655</b>  | <b>4,91 %</b>        |
| <b>Industrivaror och -tjänster</b> |         |        |                    |                      |
| AF Poyry AB B                      | 113 326 | 139,70 | 15 831 642         | 0,84 %               |
| ASSA ABLOY B                       | 231 879 | 290,30 | 67 314 474         | 3,57 %               |
| ATLAS COPCO A                      | 251 100 | 173,55 | 43 578 405         | 2,31 %               |
| ATLAS COPCO B                      | 154 474 | 149,40 | 23 078 416         | 1,23 %               |
| Bravida Holding                    | 235 357 | 81,05  | 19 075 685         | 1,01 %               |
| Concentric AB                      | 75 345  | 179,60 | 13 531 962         | 0,72 %               |
| Electrolux Professional B          | 297 063 | 55,00  | 16 338 465         | 0,87 %               |
| EPIROC A                           | 206 711 | 202,20 | 41 796 964         | 2,22 %               |
| EPIROC B                           | 133 183 | 176,40 | 23 493 481         | 1,25 %               |
| Fagerhult                          | 186 396 | 66,00  | 12 302 136         | 0,65 %               |
| HEXAGON B                          | 585 587 | 120,95 | 70 826 748         | 3,76 %               |
| HMS Networks AB                    | 34 767  | 497,40 | 17 293 106         | 0,92 %               |
| HUSQVARNA B                        | 270 669 | 82,98  | 22 460 114         | 1,19 %               |
| INSTALCO                           | 339 925 | 40,90  | 13 902 933         | 0,74 %               |
| LATOUR INVESTMENT AB B             | 107 572 | 262,30 | 28 216 136         | 1,50 %               |
| Lindab International               | 85 063  | 199,10 | 16 936 043         | 0,90 %               |
| LOOMIS B                           | 68 399  | 267,60 | 18 303 572         | 0,97 %               |
| NEW WAVE B                         | 141 277 | 101,88 | 14 393 301         | 0,76 %               |
| NIBE Industrier                    | 925 826 | 70,80  | 65 548 481         | 3,48 %               |
| OEM International B                | 138 511 | 105,40 | 14 599 059         | 0,78 %               |
| SECURITAS B                        | 382 210 | 98,58  | 37 678 262         | 2,00 %               |
|                                    |         |        | <b>596 499 383</b> | <b>31,67 %</b>       |
| <b>Finans och fastighet</b>        |         |        |                    |                      |
| Atrium Ljungberg AB                | 63 918  | 231,20 | 14 777 842         | 0,78 %               |
| Castellum AB                       | 287 264 | 143,30 | 41 164 931         | 2,19 %               |
| CATENA                             | 36 482  | 471,40 | 17 197 615         | 0,91 %               |
| COREM PROPERTY GROUP AB-B          | 627 687 | 10,62  | 6 666 036          | 0,35 %               |
| Dios Fastigheter AB                | 162 463 | 86,60  | 14 069 296         | 0,75 %               |
| EQT                                | 254 899 | 285,00 | 72 646 215         | 3,86 %               |
| FABEGE                             | 201 322 | 108,20 | 21 783 040         | 1,16 %               |
| FASTIGHETS AB BALDER-B             | 458 939 | 71,52  | 32 823 317         | 1,74 %               |

| Värdepapper              | Antal   | Kurs   | Marknadsvärde      | Andel av förmögenhet |
|--------------------------|---------|--------|--------------------|----------------------|
| FASTPARTNER AB-A         | 172 859 | 62,70  | 10 838 259         | 0,58 %               |
| Hufvudstaden A           | 120 131 | 142,10 | 17 070 615         | 0,91 %               |
| Industrivärden AB A      | 81 249  | 328,90 | 26 722 796         | 1,42 %               |
| Industrivärden AB C      | 95 257  | 328,30 | 31 272 873         | 1,66 %               |
| INTRUM AB                | 195 008 | 69,78  | 13 607 658         | 0,72 %               |
| INVESTOR A               | 67 635  | 231,50 | 15 657 503         | 0,83 %               |
| INVESTOR B               | 216 883 | 233,50 | 50 642 181         | 2,69 %               |
| KINNEVIK B               | 207 951 | 108,10 | 22 479 503         | 1,19 %               |
| LUNDBERGFÖRETAGEN B      | 54 769  | 548,20 | 30 024 366         | 1,59 %               |
| NDA SE                   | 539 553 | 124,72 | 67 293 050         | 3,57 %               |
| NYFOSA                   | 179 207 | 95,85  | 17 176 991         | 0,91 %               |
| PANDOX B                 | 108 486 | 150,40 | 16 316 294         | 0,87 %               |
| PLATZER FASTIGHETER HOLD | 142 820 | 84,20  | 12 025 444         | 0,64 %               |
| SHB A                    | 609 461 | 109,45 | 66 705 506         | 3,54 %               |
| SHB B                    | 14 214  | 130,20 | 1 850 663          | 0,10 %               |
| WALLENSTAM B             | 386 224 | 54,70  | 21 126 453         | 1,12 %               |
| WIHLBORGS FASTIGHETER AB | 234 028 | 94,25  | 22 057 139         | 1,17 %               |
|                          |         |        | <b>663 995 586</b> | <b>35,26 %</b>       |

#### Sällanköpsvaror och -tjänster

|              |         |        |                    |                |
|--------------|---------|--------|--------------------|----------------|
| Axfood AB    | 87 602  | 273,00 | 23 915 346         | 1,27 %         |
| Bilia AB     | 111 595 | 134,60 | 15 020 687         | 0,80 %         |
| BioGaia B    | 133 164 | 101,20 | 13 476 197         | 0,72 %         |
| Bufab        | 38 802  | 386,40 | 14 993 093         | 0,80 %         |
| ELECTROLUX B | 191 476 | 108,10 | 20 698 556         | 1,10 %         |
| H&M B        | 368 933 | 176,62 | 65 160 946         | 3,46 %         |
| JM AB        | 89 851  | 177,50 | 15 948 553         | 0,85 %         |
| Skistar B    | 1 921   | 119,70 | 229 944            | 0,01 %         |
| THULE GROUP  | 84 314  | 274,50 | 23 144 193         | 1,23 %         |
| Volvo Car B  | 476 591 | 32,56  | 15 517 803         | 0,82 %         |
|              |         |        | <b>208 105 317</b> | <b>11,05 %</b> |

#### Material

|                    |         |        |                    |               |
|--------------------|---------|--------|--------------------|---------------|
| BillerudKorsnas AB | 201 295 | 102,40 | 20 612 608         | 1,09 %        |
| HOLMEN B           | 63 699  | 425,70 | 27 116 664         | 1,44 %        |
| SCA B              | 372 206 | 151,10 | 56 240 327         | 2,99 %        |
|                    |         |        | <b>103 969 599</b> | <b>5,52 %</b> |

#### Telekomoperatörer

|                            |           |        |                    |               |
|----------------------------|-----------|--------|--------------------|---------------|
| Embracer Group B           | 702 928   | 27,36  | 19 228 595         | 1,02 %        |
| MILLICOM INT. CELLULAR SDB | 121 066   | 180,25 | 21 822 147         | 1,16 %        |
| MODERN TIMES GROUP B       | 150 077   | 86,15  | 12 929 134         | 0,69 %        |
| PARADOX INTERACTIVE AB     | 60 805    | 225,40 | 13 705 447         | 0,73 %        |
| StillFront Group           | 997 428   | 12,17  | 12 138 699         | 0,64 %        |
| TELE2 B                    | 375 257   | 86,54  | 32 474 741         | 1,72 %        |
| TELIA COMPANY              | 1 499 551 | 25,73  | 38 583 447         | 2,05 %        |
|                            |           |        | <b>150 882 209</b> | <b>8,01 %</b> |

#### Informationsteknik

|             |         |        |                   |               |
|-------------|---------|--------|-------------------|---------------|
| MYCRONIC AB | 66 073  | 287,40 | 18 989 380        | 1,01 %        |
| NCAB Group  | 224 035 | 73,25  | 16 410 564        | 0,87 %        |
| Sdiptech B  | 53 921  | 269,80 | 14 547 886        | 0,77 %        |
|             |         |        | <b>49 947 830</b> | <b>2,65 %</b> |

#### Dagligvaror

| Värdepapper  | Antal   | Kurs  | Marknadsvärde        | Andel av förmögenhet |
|--|---------|-------|----------------------|----------------------|
| OX2  | 261 903 | 54,85 | 14 365 380           | 0,76 %               |
|  |         |       | <b>14 365 380</b>    | <b>0,76 %</b>        |
| <b>Summa noterade aktier</b>   |         |       | <b>1 880 285 959</b> | <b>99,84 %</b>       |
| Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES. |         |       | 1 880 285 959        | 99,84 %              |
| Övriga tillgångar och skulder (netto)  |         |       | 3 101 703            | 0,16 %               |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>   |         |       | <b>1 883 387 662</b> | <b>100,00 %</b>      |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

Fonden får använda derivat som ett led i placeringsinriktningen men har under perioden inte nyttjat denna möjlighet.

# Avanza USA

Fonden är en matarfond som placerar minst 85 procent av sina medel i den passivt förvaltade mottagarfonden **Amundi Index MSCI USA SRI PAB** och i dess andelsklass I13SK. Fondens målsättning är att ge andelsägarna en avkastning som överensstämmer med mottagarfondens utveckling. Mottagarfonden är en indexfond som har som mål att följa utvecklingen av sitt jämförelseindex, vilket beaktar miljö-, sociala och bolagsstyrningsaspekter (ESG).

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 21,4 procent, vilket var 10 baspunkter sämre än mottagarfonden som ökade med 21,5 procent under samma period. Avanza USA har under hela perioden varit i det närmaste fullt ut investerad i mottagarfonden.

Trots geopolitiska spänningar, hög inflation och stigande räntor gav året bra avkastning på den amerikanska aktiemarknaden. Uppgången kan till viss del förklaras av AI-boomen som lett till kraftiga uppgångar i de amerikanska teknikjättarna. Den svenska kronan stärktes något mot US-dollar under året.

Fondens hållbara profil har bidragit negativt under året, vilket till största del förklaras av undervikten i informationsteknik jämfört med ett motsvarande index som inte tar hänsyn till hållbarhet.

De sektorer som hade störst positivt bidrag till fondens utveckling under året var informationsteknik, sällanköpsvaror och industri, medan dagligvaror, och kraftförsörjning bidrog mest negativt under perioden. Informationsteknik har alltså bidragit positivt till avkastningen att äga men det har varit negativt att vara underviktad jämfört med ett index som inte tar hänsyn till hållbarhet. Fondens tre bästa bidragsgivare bland enskilda underliggande aktier var NVIDIA, Tesla och Microsoft, medan General Mills, American Water Works och Illumina utgjorde de tre sämsta bidragsgivarna.

Den totala fondförmögenheten ökade under året i Avanza USA från 1,6 till 2,5 miljarder kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har inte möjlighet att använda sig av derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i motpartsrisk, marknadsrisk, likviditets- och valutarisk samt operativ risk.

Avanza USA placerar sina medel i mottagarfonden, vilket ger en motpartrisk för fonden gentemot mottagarfonden. Mottagarfonden investerar även i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Då mottagarfonden investerar i aktier och derivat med exponering mot aktiemarknader är en investering i fonden förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk). Mottagarfondens placeringar är koncentrerade till en region, vilket ökar risken i fonden (koncentrationsrisk).

De underliggande aktieinnehaven i mottagarfonden kännetecknas generellt av god likviditet men vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna kan det finnas en risk att inte kunna sälja andelar i mottagarfonden inom utsatt tid (likviditetsrisk).

## Fondfakta

|   |                               |
|---|-------------------------------|
| Fondens startdatum                                  | 2019-12-17                    |
| Andelsvärde   | 174,72                        |
| Fondförmögenhet, tkr                                | 2 452 404                     |
| Utveckling, %                                       | 21,40                         |
| Kursnotering  | Daglig                        |
| Inträdesavgift                                      | Ingen                         |
| Utträdesavgift                                      | Ingen                         |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>                           | 0,17                          |
| Förvaltningsavgift, %                               | 0,10                          |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %               | 0,10                          |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, % | 0,07                          |
| Omsättningshastighet, ggr                           | 0,03                          |
| Riskbedömningsmetod                                 | Åtagandemetoden               |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning |
| Förvaltare  | Martin Sandstedt              |
| Organisationsnummer                                 | 515603-0362                   |

<sup>1)</sup> Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningsswappar.

### Aktivitetsgrad

Fondens målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. För att uppnå detta placeras fondens medel i mottagarfonden. Då förvaltningen av Fondens ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden. För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

### Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

Information om mottagarfondens årsberättelse och halvårsredogörelse finns på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

Efter årsskiftet ansökt fonden om att få ändra sina fondbestämmelser. Förändringen medför att fonden går från att vara en matarfond till att bli en aktiefond. Förändringen är planerad till våren 2024.

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|---|----------------|-----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 360 517        | -149 858        |
| Övriga finansiella intäkter               | 227            | 25              |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>360 744</b> | <b>-149 833</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -2 088         | -1 522          |
| Övriga finansiella kostnader              | -19            | -36             |
| Övriga kostnader                          | -              | -14             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-2 107</b>  | <b>-1 572</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>358 637</b> | <b>-151 405</b> |

### Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 2 452 101         | 1 572 792         |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>2 452 101</b>  | <b>1 572 792</b>  |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 899               | 791               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>2 453 000</b>  | <b>1 573 583</b>  |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 596               | 416               |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>596</b>        | <b>416</b>        |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>2 452 404</b>  | <b>1 573 167</b>  |



## Tilläggsupplysningar, tkr

|   | 2023           | 2022            |
|---|----------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                |                |                 |
| <b>Värdeförändring fonder</b>               |                |                 |
| Realisationsvinster                         | 9 614          | 39 998          |
| Orealiserade vinster/förluster              | 350 903        | -189 856        |
| <b>Summa värdeförändring på fondandelar</b> | <b>360 517</b> | <b>-149 858</b> |

|   | 2023-12-31       | 2022-12-31       |
|---|------------------|------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                  |                  |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                  |                  |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 1 573 167        | 1 465 077        |
| Andelsutgivning                           | 1 103 018        | 1 016 026        |
| Andelsinlösen                             | -582 418         | -756 545         |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 358 637          | -151 405         |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>2 452 404</b> | <b>1 573 167</b> |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 2 452 404  | 1 573 167  | 1 465 077  | 489 064    | 204 589    |
| Andelsvärde              | 174,72     | 143,92     | 158,07     | 109,21     | 101,01     |
| Antal utestående andelar | 14 035 891 | 10 930 887 | 9 268 536  | 4 478 055  | 2 025 375  |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 21,40      | -8,95      | 44,74      | 8,12       | 1,01       |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          | -          | -          | -          |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          | -          | -          | -          |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,69                    | 1 388,02      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 11,34                   | 12 140,08     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,03  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,10  |
| Avgifter, % 1)2)                       | 0,17  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 18,83 |
| Transaktionskostnader, % 3)            | 0,00  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 16,50 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 5,13  |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 3 448 246 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

3) Transaktionskostnader tillkommer i mottagarfonden. Mottagarfondens årsberättelse finns att tillgå på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt

10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicy vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicy är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicy är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |            |        |               | 99,99 %              |
|--|------------|--------|---------------|----------------------|
| Värdepapper                                  | Antal      | Kurs   | Marknadsvärde | Andel av förmögenhet |
| <b>Fondandelar</b>                           |            |        |               |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                           |            |        |               |                      |
| Amundi Index Msci USA SRI                    | 13 688 181 | 179,14 | 2 452 100 674 | 99,99 %              |
|  |            |        | 2 452 100 674 | 99,99 %              |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |            |        | 2 452 100 674 | 99,99 %              |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |            |        | 2 452 100 674 | 99,99 %              |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |            |        | 303 255       | 0,01 %               |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |            |        | 2 452 403 930 | 100,00 %             |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

Fonden får inte handla med derivat.

# Avanza World Tech By TIN

Fonden är en matarfond som placerar sina medel i den aktivt förvaltade mottagarfonden TIN World Tech A. Mottagarfonden investerar globalt i teknikbolag vars produkter och/eller tjänster karaktäriseras av högt teknikinnehåll och bolag vars verksamhet kännetecknas av en hög grad av forskning och utveckling för egen eller annans räkning. En målsättning i fonden är att minst 50 procent av portföljen ska vara produkter eller tjänster som gör världen bättre och bidrar till FN:s hållbarhetsmål.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 21,0 procent vilket var i linje med mottagarfonden under samma period. Avanza World Tech by TIN har under hela perioden varit i det närmaste fullt investerad i mottagarfonden.

Börsåret 2023 blev ett händelserikt år med inledningsvis positiva tongångar och optimism, men som sedan kom att präglas av konjunktur- och ränteoro samt ökade geopolitiska spänningar. Under de första kvartalen stod de amerikanska teknikjättarna för att vara dragkraften bakom uppgången för globala bolag. Det var först under den senare delen av året, när centralbankerna började pausa sina räntehöjningar och marknaden fick förhoppningar om att räntetoppen var nådd, som riskviljan för mindre- och mer räntekänsliga bolag ökade.

De största bidragsgivarna under året var Salesforce, följt av Microsoft och Adobe. De största negativa bidragen under året kom från SolarEdge, Embracer och Enphase.

Den totala fondförmögenheten ökade under året i Avanza World Tech by TIN från 1,3 till 1,4 miljarder kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden får inte använda derivatinstrument.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i motpartsrisk, marknadsrisk, likviditet- och valutarisk samt operativ risk.

Avanza World Tech By TIN placerar sina medel i mottagarfonden vilket ger en motpartrisk för Fonden gentemot mottagarfonden. Mottagarfonden investerar även i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk.

Då mottagarfonden investerar i globala aktier och derivat med exponering mot aktiemarknader är en investering i Avanza World Tech By TIN förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk).

Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna kan det i de underliggande aktieinnehaven finnas risk för att inte kunna sälja innehaven i utsatt tid (likviditetsrisk) vilket då på motsvarande vis påverkar försäljningen av mottagarfondens andelar inom utsatt tid (likviditetsrisk).

De aktier som ingår i mottagarfonden kan handlas på ett flertal länders aktiemarknader och är då noterade i ett flertal olika underliggande valutor vilka också förändras i förhållande till den svenska kronan och därmed påverkar utvecklingen för de underliggande tillgångarna i Avanza World Tech By TIN (valutarisk).

## Fondfakta

|   |  |
|---|--|
| Fondens startdatum                                  | 2020-06-12   |
| Andelsvärde   | 127,51   |
| Fondförmögenhet, tkr                                | 1 384 483  |
| Utveckling, %                                       | 21,02  |
| Kursnotering  | Daglig   |
| Inträdesavgift                                      | Ingen  |
| Utträdesavgift                                      | Ingen  |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>                           | 1,28   |
| Förvaltningsavgift, %                               | 0,63   |
| Högsta tillåtna förvaltningsavgift, %               | 0,70   |
| Högsta tillåtna underliggande förvaltningsavgift, % | 1,65   |
| Omsättningshastighet, ggr                           | 0,01   |
| Riskbedömningsmetod                                 | Åtagandemetoden                                      |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning                        |
| Förvaltare  | Erik Sprinchorn,<br>Carl Armfelt<br>(mottagarfonden) |
| Organisationsnummer                                 | 515603-1154  |

<sup>1)</sup> Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

### Aktivitetsgrad

Avanza World Tech by TINs målsättning är att ge en avkastning som motsvarar mottagarfondens avkastning. För att uppnå detta placeras fondens medel i mottagarfonden. Då förvaltningen av Avanza World Tech by TIN ej har utformats i förhållande till en målsättning om att gå bättre eller återspegla avkastningen för ett specifikt jämförelseindex är det, i relation till att ställa fondens avkastning i förhållande till ett specifikt jämförelseindex, mer lämpligt att jämföra fondens avkastning med avkastningen för mottagarfonden för att bedöma aktivitetsgraden i förvaltningen av fonden.

För information om mottagarfondens avkastning och dess jämförelseindex samt avkastningen för detsamma, se [www.tinfonder.se](http://www.tinfonder.se).

### Övrigt

Fonden bytte förvaringsinstitut under året.

Information om mottagarfondens årsberättelse och halvårsredogörelse finns på [www.tinfonder.se](http://www.tinfonder.se).

### Resultaträkning, tkr

| <b>Intäkter</b>                           | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
|---|----------------|-----------------|
| Värdeförändring på fondandelar (Not 1)    | 263 440        | -610 753        |
| Övriga finansiella intäkter               | 12 294         | 13 278          |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b> | <b>275 733</b> | <b>-597 475</b> |
| <b>Kostnader</b>                          | <b>2023</b>    | <b>2022</b>     |
| Förvaltningskostnader                     | -8 860         | -9 648          |
| Övriga finansiella kostnader              | -26            | -41             |
| Övriga kostnader                          | -              | -13             |
| <b>Summa kostnader</b>                    | <b>-8 886</b>  | <b>-9 702</b>   |
| <b>Årets resultat</b>                     | <b>266 847</b> | <b>-607 177</b> |

### Balansräkning, tkr

| <b>Tillgångar</b>  | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
|--|-------------------|-------------------|
| Fondandelar  | 1 383 393         | 1 324 516         |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>1 383 393</b>  | <b>1 324 516</b>  |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 2 405             | 2 223             |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 812               | 979               |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>1 386 609</b>  | <b>1 327 719</b>  |
| <b>Skulder</b>   | <b>2023-12-31</b> | <b>2022-12-31</b> |
| Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter                   | 2 126             | 2 168             |
| <b>Summa skulder</b>   | <b>2 126</b>      | <b>2 168</b>      |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>1 384 483</b>  | <b>1 325 551</b>  |

## Tilläggsupplysningar, tkr

|   | 2023           | 2022            |
|---|----------------|-----------------|
| <b>Not 1</b>                                |                |                 |
| <b>Värdeförändring fonder</b>               |                |                 |
| Realisationsvinster                         | 14 172         | 27 504          |
| Realisationsförluster                       | -520           | -3 959          |
| Orealiserade vinster/förluster              | 249 787        | -634 298        |
| <b>Summa värdeförändring på fondandelar</b> | <b>263 440</b> | <b>-610 753</b> |

|   | 2023-12-31       | 2022-12-31       |
|---|------------------|------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                  |                  |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                  |                  |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 1 325 551        | 2 212 060        |
| Andelsutgivning                           | 208 091          | 321 185          |
| Andelsinlösen                             | -416 006         | -600 531         |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 266 847          | -607 177         |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>1 384 483</b> | <b>1 325 551</b> |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31 | 2022-12-31 | 2021-12-31 | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|------------|------------|------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 1 384 483  | 1 325 551  | 2 212 060  | 2 233 932  |            |
| Andelsvärde              | 127,51     | 105,36     | 148,66     | 128,68     |            |
| Antal utestående andelar | 10 857 843 | 12 581 663 | 14 880 384 | 17 359 138 |            |
| Utdelning kr/andel       | -          | -          | -          | -          |            |
| Totalavkastning, %       | 21,02      | -29,13     | 15,53      | 28,68      |            |
| Jämförelseindex, %       | -          | -          | -          | -          |            |
| Aktiv risk (2 år), %     | -          | -          | -          | -          |            |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 4,29                    | 1 388,39      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 71,29                   | 12 102,32     |

## Övrigt

|  | 2023  |
|--|-------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,01  |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00  |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,63  |
| Avgifter, % 1)2)                       | 1,28  |
| Transaktionskostnader, tkr             | 25,83 |
| Transaktionskostnader, % 3)            | 0,01  |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 20,16 |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | -7,39 |
| Analyskostnader, tkr                   | 0     |

1) Den årliga avgiften motsvarar i absoluta tal 18 139 260 kr som har betalats till förvaltarna för matar och mottagarfonden

2) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

3) Transaktionskostnader tillkommer i mottagarfonden. Mottagarfondens årsberättelse finns att tillgå på [www.tinfonder.se](http://www.tinfonder.se).

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda

som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

| Övriga finansiella instrument                |            |        |               | 99,92 %              |
|--|------------|--------|---------------|----------------------|
|  | Antal      | Kurs   | Marknadsvärde | Andel av förmögenhet |
| Värdepapper                                  |            |        |               |                      |
| Fondandelar                                  |            |        |               |                      |
| <b>Aktiefonder</b>                           |            |        |               |                      |
| TIN World Tech                               | 10 941 704 | 126,43 | 1 383 392 712 | 99,92 %              |
|  |            |        | 1 383 392 712 | 99,92 %              |
| <b>Summa fondandelar</b>                     |            |        | 1 383 392 712 | 99,92 %              |
| <b>Övriga finansiella instrument</b>         |            |        | 1 383 392 712 | 99,92 %              |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b> |            |        | 1 090 658     | 0,08 %               |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>                       |            |        | 1 384 483 370 | 100,00 %             |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

Fonden får inte handla med derivat.

# Avanza Zero

Avanza Zero är en passivt förvaltd indexfond med målsättningen att ge investerarna en förmögenhetsutveckling som i så stor utsträckning som möjligt följer utvecklingen för indexet SIX30 Return Index (SIX30RX-index). SIX30RX-index är uppbyggt kring de 30 värdemässigt mest omsatta aktierna på Stockholmsbörsen och inkluderar utdelningar. För att följa indexet investerar fonden huvudsakligen i de i index ingående aktierna.

## Förvaltningsberättelse

Fondens andelsvärde ökade under 2023 med 20,9 procent, vilket var i linje med jämförelseindexet SIX30RX som ökade 20,9 procent under samma period.

Inga förändringar skedde under året av de ingående aktierna i index.

Året inleddes starkt när förhoppningen om en inflationstopp spädde på optimismen på marknaden. En ihållande inflation, nya räntehöjningar och bankoro kom dock att prägla marknaden under det första halvåret. Storbolagen hade trots detta en stark rapportsäsong och utveckling på börsen under det första halvåret. Efter en skakig höst, som bland annat präglats av geopolitisk oro när ytterligare en konflikt blossat upp i Mellanöstern, avslutades året starkt efter förhoppningar om att räntehöjningarna var över för denna gång.

Industrivaror och -tjänster, finans och sällanköpsvaror och -tjänster utgjorde de tre sektorer som bidrog mest positivt till fondens utveckling under året, medan fastigheter och dagligvaror bidrog mest negativt. Fondens tre bästa bidragsgivare under året bland enskilda aktier var Atlas Copco A, Volvo B och Hennes & Mauritz B, medan NIBE B, Samhällsbyggnadsbolaget i Norden B och Boliden utgjorde de tre sämsta bidragsgivarna.

Den totala fondförmögenheten ökade under året i Avanza Zero från 33,7 till 45,1 miljarder kronor.

## Handel med optioner, terminer och värdepapperslån

Fonden har enligt sina fondbestämmelser rätt att använda sig av derivatinstrument som ett led i fondens placeringsinriktning i syfte att effektivisera förvaltningen av tillgångarna i fonden. Under perioden har fonden nyttjat denna möjlighet i begränsad omfattning.

Fonden har enligt sina fondbestämmelser även möjlighet att låna ut överlåtbara värdepapper ur fonden, s.k. värdepapperslån. Fonden har inte nyttjat denna möjlighet under 2023.

## Väsentliga risker förknippade med fondens innehav

Fondens risker kan främst delas upp i marknadsrisk, koncentrationsrisk, likviditetsrisk, motpartsrisk och operativ risk. Avanza Zero är en aktiefond och en investering i fonden är därmed förenat med risk för stora kurssvängningar (marknadsrisk). Eftersom fondens placeringar är koncentrerade till ett enskilt land och 30 bolagsaktier så har fonden normalt något högre risk än för fonder med placeringar i flera länder med fler underliggande bolags aktier (koncentrationsrisk). Vid extrema förhållanden på aktiemarknaderna, kan det finnas en risk att inte kunna ta ut medel ur fonden inom utsatt tid (likviditetsrisk). Vidare investerar fonden i derivat. Vid handel med derivat uppstår en begränsad motpartsrisk. Den operativa risken är risken för förluster till följd av ej ändamålsenliga eller otillräckliga

## Fondfakta

|   |                               |
|---|-------------------------------|
| Fondens startdatum  | 2006-05-22                    |
| Andelsvärde   | 383,25                        |
| Fondförmögenhet, tkr  | 45 142 863                    |
| Utveckling, %   | 20,91                         |
| Utv. jämförelseindex, %   | 20,87                         |
| Kursnotering  | Daglig                        |
| Inträdesavgift  | Ingen                         |
| Utträdesavgift  | Ingen                         |
| Avgifter, % <sup>1)</sup>   | 0,00                          |
| Förvaltningsavgift, %   | 0,00                          |
| Omsättningshastighet, ggr   | 0,05                          |
| Riskbedömningsmetod   | Åtagandemetoden               |
| Utdelning   | Fonden lämnar ingen utdelning |
| Förvaltare  | Emilie Chawala                |
| Fondnummer hos PM   | 734491                        |
| Organisationsnummer   | 515602-1031                   |
| 1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, % |                               |

| Fondens 5 största innehav | Exponering, tkr | % av fond |
|---------------------------|-----------------|-----------|
| ATLAS COPCO A             | 4 633 370       | 10,26 %   |
| INVESTOR B                | 3 382 724       | 7,49 %    |
| VOLVO B                   | 3 305 431       | 7,32 %    |
| HEXAGON B                 | 2 495 904       | 5,53 %    |
| ASSA ABLOY B              | 2 435 380       | 5,39 %    |

interna processer eller rutiner, mänskliga fel, felaktiga system eller externa händelser.

Fonden har under perioden varken exponerats mot transaktioner för värdepapperisering eller totalavkastningssvappar.

### Aktivitetsgrad

Avanza Zeros jämförelseindex är SIX30 Return Index. Indexet är relevant då det representerar det placeringsuniversum Avanza Zero placerar i.

Avanza Zero är en indexfond som har som mål att följa utvecklingen av dess jämförelseindex. För att följa indexets utveckling investerar Avanza Zero huvudsakligen i de aktier som ingår i index. En indexfond ska ha en låg aktiv risk vilket indikerar hur väl fonden följer jämförelseindex. Vissa omständigheter såsom rebalanseringar, företagshändelser samt kundflöden kan ge upphov till avvikelser mellan en indexfond och dess jämförelseindex.

Avanza Zero är passivt förvaltd och har avvikit från jämförelseindex i liten omfattning historiskt. Sett till den 24-månadersperioden, som redovisas för år 2023, har den aktiva risken stigit något jämfört mot historisk aktiv risk vilket främst beror på reallokeringar i jämförelseindex samt företagshändelser.

För information om aktivitetsgrad se tabell under "Fondens utveckling " nedan.

### Övrigt

Ansvarsbegränsning indexleverantör

Avanza Zero är inte i något avseende garanterad, godkänd emitterad eller understödd av SIX AB ("SIX") och SIX lämnar inga, vare sig uttryckliga eller implicita, garantier med avseende på de resultat som användningen av SIX30RX kan ge upphov till eller med avseende på viss tidpunkt. SIX värdet av SIX30RX vid skall intet fall vara ansvarig för fel i SIX30RX. SIX skall ej heller vara skyldig att meddela eller offentliggöra fel i SIX30RX. Alla rättigheter till varumärket SIX30RX och används i enlighet med licens från SIX.

Fonden bytte förvaringsinstitut under året och ändrade i samband med detta fondens namn från "Avanza Zero-fonden utan avgifter" till att heta "Avanza Zero".

### Resultaträkning, tkr

| Intäkter  | 2023             | 2022              |
|---|------------------|-------------------|
| Värdeförändring på överlåtbara värdepapper (Not 1)  | 6 096 111        | -6 237 269        |
| Värdeförändring på övriga derivatinstrument (Not 1) | 35 434           | -6 475            |
| Utdelningar   | 1 200 631        | 1 097 812         |
| Övriga finansiella intäkter                         | 39 315           | 27 030            |
| <b>Summa intäkter och värdeförändring</b>           | <b>7 371 490</b> | <b>-5 118 901</b> |
| <b>Årets resultat</b>                               | <b>7 371 490</b> | <b>-5 118 901</b> |

### Balansräkning, tkr

| Tillgångar   | 2023-12-31        | 2022-12-31        |
|--|-------------------|-------------------|
| Överlåtbara värdepapper  | 44 930 056        | 33 530 122        |
| <b>Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde</b> | <b>44 930 056</b> | <b>33 530 122</b> |
| Banktillgångar och andra likvida tillgångar                    | 140 017           | 88 005            |
| Förutbetalda kostnader och upplupen inkomst                    | 72 791            | 38 529            |
| <b>Summa tillgångar</b>  | <b>45 142 863</b> | <b>33 656 657</b> |
| <b>Fondförmögenhet (Not 2)</b>                                 | <b>45 142 863</b> | <b>33 656 657</b> |



## Tilläggsupplysningar, tkr

|   | 2023             | 2022              |
|---|------------------|-------------------|
| <b>Not 1</b>  |                  |                   |
| <b>Värdeförändring överlåtbara värdepapper</b>          |                  |                   |
| Realisationsvinster                                     | 151 270          | 1 616 712         |
| Realisationsförluster                                   | -23 912          | -239 384          |
| Orealiserade vinster/förluster                          | 5 968 753        | -7 614 597        |
| <b>Summa värdeförändring på överlåtbara värdepapper</b> | <b>6 096 111</b> | <b>-6 237 269</b> |

|  |               |               |
|--|---------------|---------------|
| <b>Värdeförändring övriga derivat</b>          |               |               |
| Realisationsvinster                            | 162 422       | 116 417       |
| Realisationsförluster                          | -126 988      | -122 891      |
| <b>Summa värdeförändring på övriga derivat</b> | <b>35 434</b> | <b>-6 475</b> |

|   | 2023-12-31        | 2022-12-31        |
|---|-------------------|-------------------|
| <b>Not 2</b>                              |                   |                   |
| <b>Förändring av tillgångar</b>           |                   |                   |
| Fondförmögenheten vid periodens början    | 33 656 657        | 38 410 639        |
| Andelsutgivning                           | 7 600 622         | 4 673 296         |
| Andelsinlösen                             | -3 485 906        | -4 308 378        |
| Årets resultat enligt resultaträkning     | 7 371 490         | -5 118 901        |
| <b>Fondförmögenhet vid periodens slut</b> | <b>45 142 863</b> | <b>33 656 657</b> |

## Fondens utveckling

|                          | 2023-12-31  | 2022-12-31  | 2021-12-31  | 2020-12-31 | 2019-12-31 |
|--------------------------|-------------|-------------|-------------|------------|------------|
| Fondförmögenhet, tkr     | 45 142 863  | 33 656 657  | 38 410 639  | 24 257 256 | 21 555 126 |
| Andelsvärde              | 383,25      | 316,98      | 365,39      | 275,56     | 256,57     |
| Antal utestående andelar | 117 790 626 | 106 179 820 | 105 121 612 | 88 030 135 | 84 012 204 |
| Utdelning kr/andel       | -           | -           | -           | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | 20,91       | -13,25      | 32,60       | 7,40       | 30,65      |
| Jämförelseindex, %       | 20,87       | -12,86      | 32,70       | 7,43       | 30,73      |
| Aktiv risk (2 år), %     | 0,18        | 0,17        | 0,04        | 0,04       | 0,11       |
|                          | 2018-12-31  | 2017-12-31  | 2016-12-31  | 2015-12-31 | 2014-12-31 |
| Fondförmögenhet, tkr     | 15 914 880  | 17 977 911  | 15 057 320  | 13 090 753 | 11 816 452 |
| Andelsvärde              | 196,38      | 211,12      | 195,95      | 179,24     | 175,37     |
| Antal utestående andelar | 81 039 910  | 85 154 640  | 76 841 907  | 73 033 833 | 67 381 206 |
| Utdelning kr/andel       | -           | -           | -           | -          | -          |
| Totalavkastning, %       | -6,98       | 7,74        | 9,32        | 2,21       | 14,04      |
| Jämförelseindex, %       | -7,04       | 7,67        | 9,41        | 2,23       | 13,95      |
| Aktiv risk (2 år), %     | 0,11        | 0,06        | 0,04        | 0,05       | 0,05       |

## Förvaltningskostnad under perioden

|                               | Förvaltningskostnad, kr | Marknadsvärde |
|-------------------------------|-------------------------|---------------|
| Månadssparande om 100kr/månad | 0,00                    | 1 424,04      |
| Engångsinsättning om 10 000kr | 0,00                    | 12 090,67     |

## Övrigt

|  | <b>2023</b> |
|--|-------------|
| Omsättningshastighet, ggr              | 0,05        |
| Omsättning genom närstående företag, % | 0,00        |
| Förvaltningsavgift, %                  | 0,00        |
| Avgifter, % 1)                         | 0,00        |
| Transaktionskostnader, tkr             | -           |
| Transaktionskostnader, %               | 0,00        |
| Totalrisk fond (2 år), %               | 17,85       |
| Totalrisk jämförelseindex (2 år), %    | 17,87       |
| Genomsnittlig årsavkastning (2 år), %  | 2,41        |
| Genomsnittlig årsavkastning (5 år), %  | 14,31       |
| Analyskostnader, tkr                   | 0           |

1) Förvaltningsavgifter och andra administrations- eller driftskostnader, %

Fondbolaget har under 2023 betalat fasta ersättningar om 9 418 000 kronor till särskilt reglerad personal som består av verkställande ledning, ansvariga för kontrollfunktioner, anställda i ledande strategiska befattningar samt anställda som väsentligt påverkar den alternativa investeringsfondens/värdepappersfondens riskprofil fördelat på sammanlagt 10 personer. Det finns ingen anställd vars ersättning uppgår till eller överstiger den totala ersättningen till någon i den verkställande ledningen. Totalt har det betalats ut fasta ersättningar om 14 888 000 kronor till 23 betalningsmottagare. Fondbolaget har inte betalat ut några rörliga ersättningar under 2023.

Styrelsen i Fondbolaget har låtit funktionen för internrevision granska Fondbolagets ersättningssystem 2023. Mål och syfte med revisionen var att kartlägga och bedöma interna och externa krav. Funktionen för internrevision har inte noterat några väsentliga avvikelser.

Styrelsen i Fondbolaget har antagit en ersättningspolicy som främjar en sund och effektiv riskhantering. Inga väsentliga förändringar av ersättningspolicyn vidtogs under 2023. Alla anställda i Fondbolaget omfattas enbart av fast ersättning. Den fasta ersättningen är på förhand bestämd för det arbete den anställda är anställd för att utföra och ersättningen speglar relevant yrkeserfarenhet och organisatoriskt ansvar. Ersättningspolicyn är fastställd för att uppmuntra till goda prestationer samtidigt som den är utformad för att motverka överdrivet risktagande som är oförenligt med Fondbolagets förvaltade fonders riskprofiler i syfte att motverka intressekonflikter samt främja en sund och effektiv riskhantering. Ersättningssystemet ska även överensstämma med Fondbolagets affärsstrategi, mål, värderingar och långsiktiga intressen. Information om aktuell ersättningspolicy finns tillgänglig på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se). Ersättningspolicyn är upprättad i enlighet med Finansinspektionens föreskrifter FFFS 2013:9 och FFFS 2013:10. Kostnadsfri papperskopia tillhandahålls på begäran genom att kontakta Avanza Fonder AB.

## Finansiella instrument

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.

99,53 %

| Värdepapper                          | Antal      | Kurs     | Marknadsvärde         | Andel av förmögenhet |
|--------------------------------------|------------|----------|-----------------------|----------------------|
| <b>Noterade aktier</b>               |            |          |                       |                      |
| <b>Industrivaror och -tjänster</b>   |            |          |                       |                      |
| ABB LTD                              | 3 633 085  | 445,30   | 1 617 812 751         | 3,58 %               |
| ALFA LAVAL                           | 3 286 544  | 403,40   | 1 325 791 850         | 2,94 %               |
| ASSA ABLOY B                         | 8 389 182  | 290,30   | 2 435 379 535         | 5,39 %               |
| ATLAS COPCO A                        | 26 697 607 | 173,55   | 4 633 369 695         | 10,26 %              |
| ATLAS COPCO B                        | 12 411 230 | 149,40   | 1 854 237 762         | 4,11 %               |
| HEXAGON B                            | 20 635 830 | 120,95   | 2 495 903 639         | 5,53 %               |
| NIBE Industrier                      | 14 176 931 | 70,80    | 1 003 726 715         | 2,22 %               |
| SANDVIK                              | 9 974 189  | 218,10   | 2 175 370 621         | 4,82 %               |
| SKF B                                | 3 387 590  | 201,30   | 681 921 867           | 1,51 %               |
| VOLVO B                              | 12 630 610 | 261,70   | 3 305 430 637         | 7,32 %               |
|                                      |            |          | <b>21 528 945 070</b> | <b>47,69 %</b>       |
| <b>Hälsovård</b>                     |            |          |                       |                      |
| ASTRA ZENECA                         | 1 274 104  | 1 353,50 | 1 724 499 764         | 3,82 %               |
| GETINGE B                            | 2 020 880  | 224,30   | 453 283 384           | 1,00 %               |
|                                      |            |          | <b>2 177 783 148</b>  | <b>4,82 %</b>        |
| <b>Sällanköpsvaror och -tjänster</b> |            |          |                       |                      |
| AUTOLIV                              | 235 579    | 1 104,00 | 260 079 216           | 0,58 %               |
| ELECTROLUX B                         | 2 185 739  | 108,10   | 236 278 386           | 0,52 %               |
| Essity B                             | 5 098 957  | 250,00   | 1 274 739 250         | 2,82 %               |
| Evolution AB                         | 1 714 371  | 1 202,20 | 2 061 016 816         | 4,57 %               |
| H&M B                                | 11 412 614 | 176,62   | 2 015 695 885         | 4,47 %               |
|                                      |            |          | <b>5 847 809 553</b>  | <b>12,95 %</b>       |
| <b>Material</b>                      |            |          |                       |                      |
| BOLIDEN                              | 2 174 810  | 314,50   | 683 977 745           | 1,52 %               |
| SCA B                                | 5 071 692  | 151,10   | 766 332 661           | 1,70 %               |
|                                      |            |          | <b>1 450 310 406</b>  | <b>3,21 %</b>        |
| <b>Informationsteknik</b>            |            |          |                       |                      |
| ERICSSON B                           | 24 509 522 | 63,11    | 1 546 795 933         | 3,43 %               |
| SINCH AB                             | 6 703 629  | 37,51    | 251 453 124           | 0,56 %               |
|                                      |            |          | <b>1 798 249 057</b>  | <b>3,98 %</b>        |
| <b>Finans och fastighet</b>          |            |          |                       |                      |
| INVESTOR B                           | 14 487 042 | 233,50   | 3 382 724 307         | 7,49 %               |
| KINNEVIK B                           | 1 933 930  | 108,10   | 209 057 833           | 0,46 %               |
| NDA SE                               | 10 918 150 | 124,72   | 1 361 711 668         | 3,02 %               |
| SAMHÄLLSBYGGNADSBO I NORDEN B        | 9 892 913  | 5,06     | 50 097 711            | 0,11 %               |
| SEB A                                | 16 823 929 | 138,80   | 2 335 161 345         | 5,17 %               |
| SHB A                                | 15 463 802 | 109,45   | 1 692 513 129         | 3,75 %               |
| SWED A                               | 9 001 089  | 203,30   | 1 829 921 394         | 4,05 %               |
|                                      |            |          | <b>10 861 187 387</b> | <b>24,06 %</b>       |

**Telekomoperatörer**

|   |            |       |                |          |
|---|------------|-------|----------------|----------|
| TELE2 B   | 5 330 452  | 86,54 | 461 297 316    | 1,02 %   |
| TELIA COMPANY   | 31 265 978 | 25,73 | 804 473 614    | 1,78 %   |
|   |            |       | <hr/>          |          |
|   |            |       | 1 265 770 930  | 2,80 %   |
| <b>Summa noterade aktier</b>  |            |       | <hr/>          | <hr/>    |
|   |            |       | 44 930 055 551 | 99,53 %  |
| <b>Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES.</b> |            |       | <hr/>          | <hr/>    |
|   |            |       | 44 930 055 551 | 99,53 %  |
| <b>Övriga tillgångar och skulder (netto)</b>  |            |       | <hr/>          | <hr/>    |
|   |            |       | 212 807 828    | 0,47 %   |
| <b>FONDFÖRMÖGENHET</b>  |            |       | <hr/>          | <hr/>    |
|   |            |       | 45 142 863 379 | 100,00 % |

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det investerade kapitalet.

Detta är en gemensam årsredogörelse för samtliga fonder som Avanza Fonder AB förvaltar.

# Avanza Fonder AB

---

## Riskinformation

Sparande i fonder innebär alltid en risk. Fonder kan såväl öka som minska i värde. Det beror, bland annat, på utvecklingen på världens börser, ränteutvecklingen och förändringar i valutakurser. Det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta kapitalet

---

Avanza Fonder AB (nedan "Fondbolaget") har Finansinspektionens tillstånd att bedriva fondverksamhet enligt lagen (2004:46) om värdepappersfonder sedan den 3 maj 2006 samt att förvalta alternativa investeringsfonder enligt lagen (2013:561) om förvaltare av alternativa investeringsfonder sedan den 29 april 2015. Fondbolaget är ett helägt dotterbolag till Avanza Bank Holding AB (publ.) och följer svensk kod för fondbolag. Koden reviderades senast den 13 maj 2019. Mer information finns på [www.avanzafonder.se](http://www.avanzafonder.se).

---

**Organisationsnummer:** 556664-3531

**Fonder under förvaltning:** Avanza Zero, Avanza Sverige, Avanza 50, Avanza 75, Avanza 100, Avanza Auto 1, Avanza Auto 2, Avanza Auto 3, Avanza Auto 4, Avanza Auto 5, Avanza Auto 6, Avanza Emerging Markets, Avanza Global, Avanza USA, Avanza Europa, Avanza World Tech by TIN, Avanza Småbolag by Skoglund, Avanza Fastighet by Norhammar, Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest, Avanza Impact by Circulus, Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult, Avanza Ränta Kort samt Avanza Ränta Global.

**Adress:** Regeringsgatan 103, Box 1399

111 39 Stockholm

**Telefon:** 08-562 250 00

**Aktiekapital:** 3 100 000 SEK

**Verkställande direktör:** Jesper Bonnivier

**Styrelse:** Mattias Karlén (ordförande), Erik Törnberg, Hans Toll och Marie Andén

**Förvaringsinstitut:** Skandinaviska Enskilda Banken AB, Kungsträdgårdsgatan 8, 111 47 Stockholm

**Revisor:** Dan Beitner Auktoriserad revisor KPMG AB

---

## Redovisningsprinciper

Årsberättelsen har för värdepappersfonderna upprättats enligt lagen (2004:46) om värdepappersfonder samt Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2013:9) om värdepappersfonder. För specialfonderna har årsberättelsen upprättats enligt lag (2013:561) om förvaltare av alternativa investeringsfonder samt Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2013:10) om förvaltare av alternativa investeringsfonder. Årsberättelsen har upprättats i enlighet med ESMA:s riktlinjer samt följer Fondbolagens förenings riktlinjer för redovisning av nyckeltal avseende svenska värdepappersfonder och specialfonder.

## Värderingsprinciper

Finansiella instrument som ingår i fonden värderas med ledning av gällande marknadskurser. Om sådana kurser inte är tillgängliga eller om kurserna enligt fondbolagets bedömning är missvisande får de värderas på objektiva grunder enligt allmänt vedertagna värderingsprinciper. Respektive fonds fondbestämmelser anger närmare hur tillgångarna i fonden värderas och hur fondens värde fastställs.

---

Påskriften avser årsberättelse för samtliga fonder som förvaltas av Fondbolaget.

Jesper Bonnier  
*Verkställande direktör*

Styrelse  
Stockholm 23 april 2024

Mattias Karlén      Hans Toll      Marie Andén      Erik Törnberg  
*Ordförande*

Vår revisionsberättelse har angivits den 23 april 2024  
KPMG AB

Dan Beitner  
*Auktoriserad revisor*

# Revisionsberättelse

Till andelsägarna i Specialfonderna:

Avanza 50, org.nr 515602-5859; Avanza 75, org. nr. 515602-5867; Avanza 100, org. nr. 515602-5875; Avanza Auto 1, org. nr. 515602-8945; Avanza Auto 2, org. nr. 515602-8952; Avanza Auto 3, org. nr. 515602-8960; Avanza Auto 4, org. nr. 515602-8978; Avanza Auto 5, org. nr. 515602-8986; Avanza Auto 6, org.nr 515602-8994

## Rapport om årsberättelse

### Uttalande

Vi har i egenskap av revisorer i Avanza Fonder AB, organisationsnummer 556664-3531, utfört en revision av årsberättelserna för ovanstående specialfonder för år 2023 med undantag för hållbarhetsinformationen på sidorna 121-210. Ovanstående specialfonders årsberättelser ingår på sidorna 1-45 i detta dokument.

Enligt vår uppfattning har årsberättelserna upprättats i enlighet med lagen om förvaltare av alternativa investeringsfonder och Finansinspektionens föreskrifter om förvaltare av alternativa investeringsfonder och ger en i alla väsentliga avseenden rättvisande bild av ovanstående specialfonders finansiella ställning per den 31 december 2023 och av dess finansiella resultat för året enligt lagen om förvaltare av alternativa investeringsfonder och Finansinspektionens föreskrifter om förvaltare av alternativa investeringsfonder. Vårt uttalande omfattar inte hållbarhetsinformationen på sidorna 121-210.

### Grund för uttalande

Vi har utfört revisionen enligt International Standards on Auditing (ISA) och god revisionsssed i Sverige. Vårt ansvar enligt dessa standarder beskrivs närmare i avsnittet Revisorns ansvar. Vi är oberoende i förhållande till fondbolaget enligt god revisorssed i Sverige och har i övrigt fullgjort vårt yrkesetiska ansvar enligt dessa krav.

Vi anser att de revisionsbevis vi har inhämtat är tillräckliga och ändamålsenliga som grund för vårt uttalande.

### Annan information än årsberättelserna

Detta dokument innehåller även annan information än årsberättelserna och återfinns på sidorna 121-210. Den andra informationen består av hållbarhetsinformationen. Det är fondbolaget som har ansvaret för denna andra information.

Vårt uttalande avseende årsberättelserna omfattar inte denna information och vi gör inget uttalande med bestyrkande avseende denna andra information.

I samband med vår revision av årsberättelserna är det vårt ansvar att läsa den information som identifieras ovan och överväga om informationen i väsentlig utsträckning är oförenlig med årsberättelserna. Vid denna genomgång beaktar vi även den kunskap vi i övrigt inhämtat under revisionen samt bedömer om informationen i övrigt verkar innehålla väsentliga felaktigheter.

Om vi, baserat på det arbete som har utförts avseende denna information, drar slutsatsen att den andra informationen innehåller en väsentlig felaktighet, är vi skyldiga att rapportera detta. Vi har inget att rapportera i det avseendet.

### Fondbolagets ansvar

Det är fondbolaget som har ansvaret för att årsberättelserna upprättas och att de ger en rättvisande bild enligt lagen om förvaltare av alternativa investeringsfonder och Finansinspektionens föreskrifter om förvaltare av alternativa investeringsfonder.

Fondbolaget ansvarar även för den interna kontroll som det bedömer är nödvändig för att upprätta en årsberättelse som inte innehåller några väsentliga felaktigheter, vare sig dessa beror på oegentligheter eller misstag.

### Revisorns ansvar

Våra mål är att uppnå en rimlig grad av säkerhet om huruvida årsberättelserna som helhet inte innehåller några väsentliga felaktigheter, vare sig dessa beror på oegentligheter eller misstag, och att lämna en revisionsberättelse som innehåller vårt uttalande. Rimlig säkerhet är en hög grad av säkerhet, men är ingen garanti för att en revision som utförs enligt ISA och god revisionsssed i Sverige alltid kommer att upptäcka en väsentlig felaktighet om en sådan finns. Felaktigheter kan uppstå på grund av oegentligheter eller misstag och anses vara väsentliga om de enskilt eller tillsammans rimligen kan förväntas påverka de ekonomiska beslut som användare fattar med grund i årsberättelserna.

Som del av en revision enligt ISA använder vi professionellt omdöme och har en professionellt skeptisk inställning under hela revisionen. Dessutom:

- identifierar och bedömer vi riskerna för väsentliga felaktigheter i årsberättelserna, vare sig dessa beror på oegentligheter eller misstag, utformar och utför granskningsåtgärder bland annat utifrån dessa risker och inhämtar revisionsbevis som är tillräckliga och ändamålsenliga för att utgöra en grund för vårt uttalande. Risken för att inte upptäcka en väsentlig felaktighet till följd av oegentligheter är högre än för en väsentlig felaktighet som beror på misstag, eftersom oegentligheter kan innefatta agerande i maskopi, förfalskning, avsiktliga utelämnanden, felaktig information eller åsidosättande av intern kontroll.

— skaffar vi oss en förståelse av den del av fondbolagets interna kontroll som har betydelse för vår revision för att utforma granskningsåtgärder som är lämpliga med hänsyn till omständigheterna, men inte för att uttala oss om effektiviteten i den interna kontrollen.

— utvärderar vi lämpligheten i de redovisningsprinciper som används och rimligheten i fondbolagets uppskattningar i redovisningen och tillhörande upplysningar.

— utvärderar vi den övergripande presentationen, strukturen och innehållet i årsberättelserna, däribland upplysningarna, och om årsberättelserna återger de underliggande transaktionerna och händelserna på ett sätt som ger en rättvisande bild.

Vi måste informera fondbolaget om bland annat revisionens planerade omfattning och inriktning samt tidpunkten för den. Vi måste också informera om betydelsefulla iakttagelser under revisionen, däribland de eventuella betydande brister i den interna kontrollen som vi identifierat.



---

### Revisorns yttrande avseende den lagstadgade hållbarhetsinformationen

Det är fondbolaget som har ansvaret för hållbarhetsinformationen på sidorna 121-210 och för att den är upprättad i enlighet med lagen om förvaltare av alternativa investeringsfonder.

Vår granskning av hållbarhetsinformationen för fonden har skett med vägledning i tillämpliga fall av FARs rekommendation RevR 12 *Revisorns yttrande om den lagstadgade hållbarhetsrapporten*. Detta innebär att vår granskning av hållbarhetsinformationen har en annan inriktning och en väsentligt mindre omfattning jämfört med den inriktning och omfattning som en revision enligt International Standards on Auditing och god revisionssed i Sverige har. Vi anser att denna granskning ger oss tillräcklig grund för vårt uttalande.

Hållbarhetsinformation har lämnats i årsberättelserna.

Stockholm den 23 april 2024

KPMG AB

Dan Beitner  
Auktoriserad revisor



# Revisionsberättelse

Till andelsägarna i Värdepappersfonderna:

Avanza Emerging Markets, org.nr 515603-0297; Avanza Europa, org. nr. 515603-0693; Avanza Global, org. nr. 515603-0016; Avanza Småbolag by Skoglund, org. nr. 515603-1477; Avanza USA, org. nr. 515603-0362; Avanza World Tech by TIN, org. nr. 515603-1154; Avanza Sverige, org. nr. 515603-1311; Avanza Zero, org. nr. 515602-1031; Avanza Fastighet by Norhammar, org. nr 515603-1949; Avanza Ränta Global, org.nr 515603-3176; Avanza Ränta Kort, org.nr 515603-3168; Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest, org.nr 515603-2665; Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult, org.nr 515603-2822; Avanza Impact by Circulus, org.nr 515603-2723

## Rapport om årsberättelse

### Uttalande

Vi har i egenskap av revisorer i Avanza Fonder AB, organisationsnummer 556664-3531, utfört en revision av årsberättelserna för ovanstående värdepappersfonder för år 2023 med undantag för hållbarhetsinformationen på sidorna 221-356. Ovanstående värdepappersfonders årsberättelser ingår på sidorna 46-111 i detta dokument.

Enligt vår uppfattning har årsberättelserna upprättats i enlighet med lagen om värdepappersfonder samt Finansinspektionens föreskrifter om värdepappersfonder och ger en i alla väsentliga avseenden rättvisande bild av ovanstående värdepappersfonders finansiella ställning per den 31 december 2023 och av dess finansiella resultat för året enligt lagen om värdepappersfonder samt Finansinspektionens föreskrifter om värdepappersfonder. Vårt uttalande omfattar inte hållbarhetsinformationen på sidorna 221-356.

### Grund för uttalande

Vi har utfört revisionen enligt International Standards on Auditing (ISA) och god revisionssed i Sverige. Vårt ansvar enligt dessa standarder beskrivs närmare i avsnittet Revisorns ansvar. Vi är oberoende i förhållande till fondbolaget enligt god revisorssed i Sverige och har i övrigt fullgjort vårt yrkesetiska ansvar enligt dessa krav.

Vi anser att de revisionsbevis vi har inhämtat är tillräckliga och ändamålsenliga som grund för vårt uttalande.

### Annan information än årsberättelserna

Detta dokument innehåller även annan information än årsberättelserna och återfinns på sidorna 221-356. Den andra informationen består av hållbarhetsinformationen. Det är fondbolaget som har ansvaret för denna andra information.

Vårt uttalande avseende årsberättelserna omfattar inte denna information och vi gör inget uttalande med bestyrkande avseende denna andra information.

I samband med vår revision av årsberättelserna är det vårt ansvar att läsa den information som identifieras ovan och överväga om informationen i väsentlig utsträckning är oförenlig med årsberättelserna. Vid denna genomgång beaktar vi även den kunskap vi i övrigt inhämtat under revisionen samt bedömer om informationen i övrigt verkar innehålla väsentliga felaktigheter.

Om vi, baserat på det arbete som har utförts avseende denna information, drar slutsatsen att den andra informationen innehåller en väsentlig felaktighet, är vi skyldiga att rapportera detta. Vi har inget att rapportera i det avseendet.

### Fondbolagets ansvar

Det är fondbolaget som har ansvaret för att årsberättelserna upprättas och att de ger en rättvisande bild enligt lagen om värdepappersfonder samt Finansinspektionens föreskrifter om värdepappersfonder.

Fondbolaget ansvarar även för den interna kontroll som det bedömer är nödvändig för att upprätta en årsberättelse som inte innehåller några väsentliga felaktigheter, vare sig dessa beror på oegentligheter eller misstag.

### Revisorns ansvar

Våra mål är att uppnå en rimlig grad av säkerhet om huruvida årsberättelserna som helhet inte innehåller några väsentliga felaktigheter, vare sig dessa beror på oegentligheter eller misstag, och att lämna en revisionsberättelse som innehåller vårt uttalande. Rimlig säkerhet är en hög grad av säkerhet, men är ingen garanti för att en revision som utförs enligt ISA och god revisionssed i Sverige alltid kommer att upptäcka en väsentlig felaktighet om en sådan finns. Felaktigheter kan uppstå på grund av oegentligheter eller misstag och anses vara väsentliga om de enskilt eller tillsammans rimligen kan förväntas påverka de ekonomiska beslut som användare fattar med grund i årsberättelserna.

Som del av en revision enligt ISA använder vi professionellt omdöme och har en professionellt skeptisk inställning under hela revisionen. Dessutom:

- identifierar och bedömer vi riskerna för väsentliga felaktigheter i årsberättelserna, vare sig dessa beror på oegentligheter eller misstag, utformar och utför granskningsåtgärder bland annat utifrån dessa risker och inhämtar revisionsbevis som är tillräckliga och ändamålsenliga för att utgöra en grund för vårt uttalande. Risken för att inte upptäcka en väsentlig felaktighet till följd av oegentligheter är högre än för en väsentlig felaktighet som beror på misstag, eftersom oegentligheter kan innefatta agerande i maskopi, förfalskning, avsiktliga utelämnanden, felaktig information eller åsidosättande av intern kontroll.

- skaffar vi oss en förståelse av den del av fondbolagets interna kontroll som har betydelse för vår revision för att utforma granskningsåtgärder som är lämpliga med hänsyn till omständigheterna, men inte för att uttala oss om effektiviteten i den interna kontrollen.
- utvärderar vi lämpligheten i de redovisningsprinciper som används och rimligheten i fondbolagets uppskattningar i redovisningen och tillhörande upplysningar.
- utvärderar vi den övergripande presentationen, strukturen och innehållet i årsberättelserna, däribland upplysningarna, och om årsberättelserna återger de underliggande transaktionerna och händelserna på ett sätt som ger en rättvisande bild.

Vi måste informera fondbolaget om bland annat revisionens planerade omfattning och inriktning samt tidpunkten för den. Vi måste också informera om betydelsefulla iakttagelser under revisionen, däribland de eventuella betydande brister i den interna kontrollen som vi identifierat.



---

### Revisorns yttrande avseende den lagstadgade hållbarhetsinformationen

Det är fondbolaget som har ansvaret för hållbarhetsinformationen på sidorna 221-356 och för att den är upprättad i enlighet med lagen om värdepappersfonder.

Vår granskning av hållbarhetsinformationen för fonderna har skett med vägledning i tillämpliga fall av FARs rekommendation RevR 12 *Revisorns yttrande om den lagstadgade hållbarhetsrapporten*. Detta innebär att vår granskning av hållbarhetsinformationen har en annan inriktning och en väsentligt mindre omfattning jämfört med den inriktning och omfattning som en revision enligt International Standards on Auditing och god revisionssed i Sverige har. Vi anser att denna granskning ger oss tillräcklig grund för vårt uttalande.

Hållbarhetsinformation har lämnats i årsberättelserna.

Stockholm den 23 april 2024

KPMG AB

Dan Beitner  
Auktoriserad revisor

## 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-taxonomi 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.

## BILAGA IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

Produktnamn: Avanza Auto 4

Identifieringskod för juridiska personer: SE0009779689

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorda 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 gjorda hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%

Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men gjorde inte några hållbara investeringar



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** [räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]

Avanza Auto 4 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden främst placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, främst placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment* ("PRI") samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

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

#### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Resultatet har, genom att Fondens placeringar under perioden uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till kraven i artikel 8 och/eller 9 i Disclosureförordningen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som säkerställer efterlevnad av internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobaksproduktion

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från tobak, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från spelverksamhet, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från pornografiskt material, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter som överstiger 5 procent från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Resultatet av hållbarhetsindikatorerna förbättrades jämfört med resultatet för föregående period genom att Fonden under föregående period hade ett innehav i Amundi Index Global Agg. Nämnda fond utgjorde inte en fond som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* alternativt fond som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Innehavet i Amundi Index Global Agg byttes i december 2022 mot ett motsvarande innehav i Amundi Global Agg SRI. Efter bytet, som genomfördes under december 2022, har samtliga Fondens innehav, utgjort fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana

investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

***Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

***Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklARATION om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

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

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*I EU-taxonomin fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonominns mål, och åtföljs av särskilda unionskriterier.*

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.*



### **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades*

*huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i under perioden. Fonden har undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                            | Sektor | % tillgångar | Land      |
|--|--------|--------------|-----------|
| Captor Iris Bond A (SE0012204758)                  | N/A    | 19,99%       | Sverige   |
| Swedbank Robur Access USA A (SE0007074083)         | N/A    | 10,46%       | Sverige   |
| Storebrand USA A SEK (SE0000594111)                | N/A    | 10,34%       | Sverige   |
| Amundi IS MSCI USA SRI PAB I13 SK C (LU2059754973) | N/A    | 10,23%       | Luxemburg |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden placerade under perioden huvudsakligen i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden hade inget åtagande att göra hållbara investeringar.

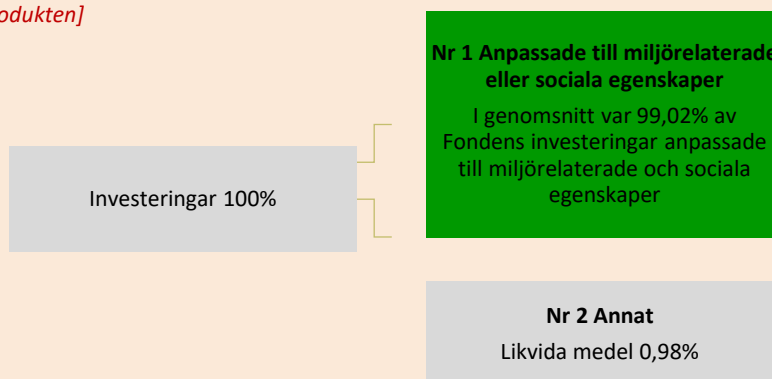
### ● Vad var tillgångsallokeringen?

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.



[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

- **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 19,4%        |
| Industri                      | 17,2%        |
| Finans                        | 15,5%        |
| Hälsovård                     | 12,1%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,1%        |
| Telekommunikation             | 7,2%         |
| Fastigheter                   | 6,3%         |
| Dagligvaror                   | 6,2%         |
| Material                      | 4,8%         |
| Kraftförsörjning              | 1,3%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin? *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel*

*6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel under perioden.

### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

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

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

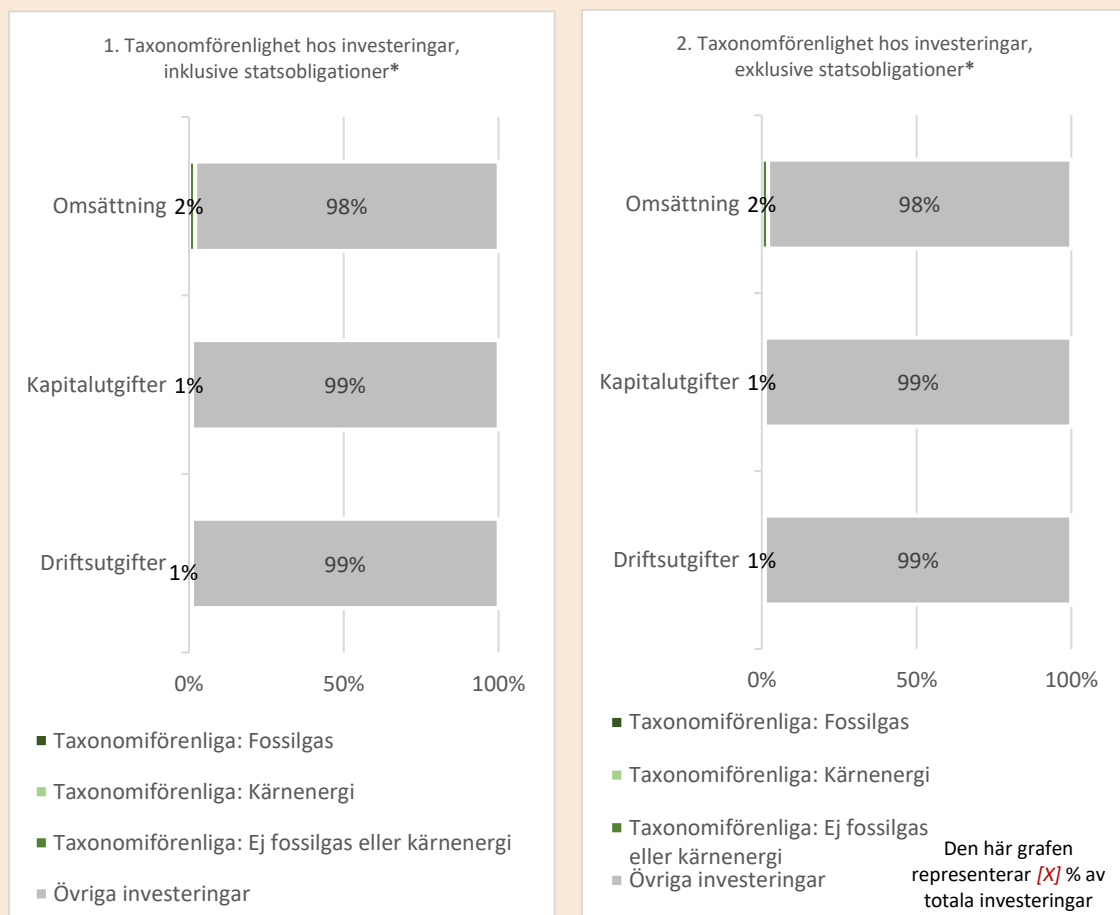
- **omsättning**, vilket återspeglar andelen av intäkterna från investeringsobjektens gröna verksamheter  
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjektet, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi.  
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens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

Det är direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål.

**Omställningsverksamheter är** verksamheter som det ännu inte finns koldioxid snåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 3 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 5 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som

avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period

som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden främst placerat i sådana fonder som främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som hade hållbara investeringar som mål och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

## 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-taxonomi 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 taxonomi eller inte.

## BILAGA IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

Produktnamn: Avanza Auto 6

Identifieringskod för juridiska personer: SE0009779705

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorde hållbara investeringar med ett miljömål: \_\_\_%

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

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

Den gjorde hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%

Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel på \_\_\_% hållbara investeringar

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

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

med ett socialt mål

Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men gjorde inte några hållbara investeringar



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** [räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]

Avanza Auto 6 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, enbart placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment* ("PRI") samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

#### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Resultatet har, genom att Fondens placeringar under perioden uteslutande utgjorts av fonder som antingen lever upp till kraven i artikel 8 eller 9 i Disclosureförordningen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som säkerställer efterlevnad av internationella normer och konventioner såsom FN Global

Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

*Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen*

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

*Andel av intäkter från tobaksproduktion*

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från tobak, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

*Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)*

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från spelverksamhet, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

*Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material*

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från pornografiskt material, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

*Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)*

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter som överstiger 5 procent från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** *[inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars



placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*

**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.



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i under perioden. Fonden har undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna  | Sektor | % tillgångar | Land      |
|--|--------|--------------|-----------|
| Storebrand USA A SEK<br>(SE0000594111)                                   | N/A    | 12,35%       | Sverige   |
| Swedbank Robur Access<br>USA A<br>(SE0007074083)                         | N/A    | 12,24%       | Sverige   |
| Amundi IS MSCI USA<br>SRI PAB I13 SK C<br>(LU2059754973)                 | N/A    | 12,21%       | Luxemburg |
| Swedbank Robur Access<br>Edge Japan A<br>(SE0007074091)                  | N/A    | 7,55%        | Sverige   |
| Amundi IS MSCI<br>Emerging Markets SRI<br>PAB I13 SK C<br>(LU2059754627) | N/A    | 6,97%        | Luxemburg |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

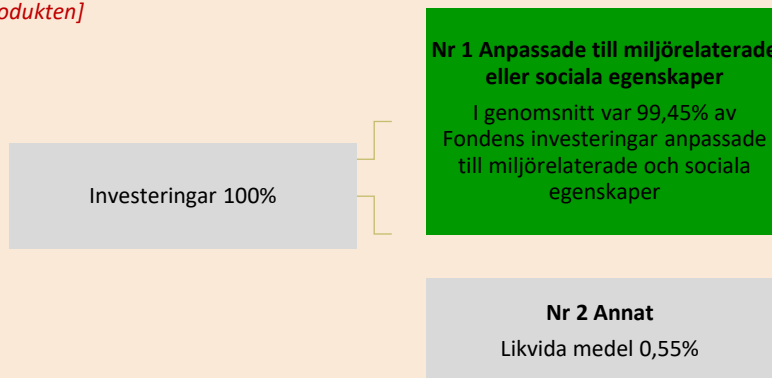
Fonden placerade under perioden uteslutande i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden hade inget åtagande att göra hållbara investeringar.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som lever upp till kraven i artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Industri                      | 18,9%        |
| Teknik                        | 18,3%        |
| Finans                        | 15,9%        |
| Hälsovård                     | 11,4%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,1%        |
| Fastigheter                   | 6,6%         |
| Telekommunikation             | 6,6%         |
| Dagligvaror                   | 6,0%         |
| Material                      | 4,8%         |
| Kraftförsörjning              | 1,3%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel*

*6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

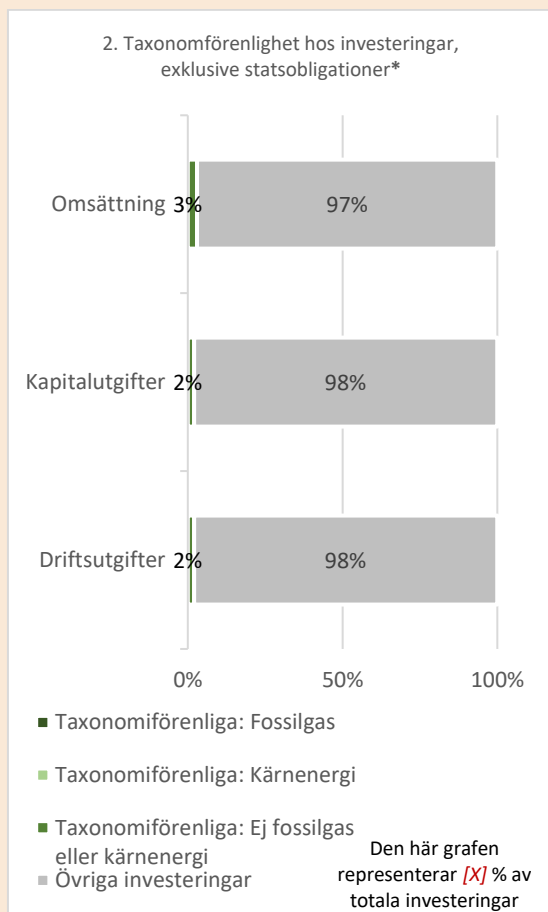
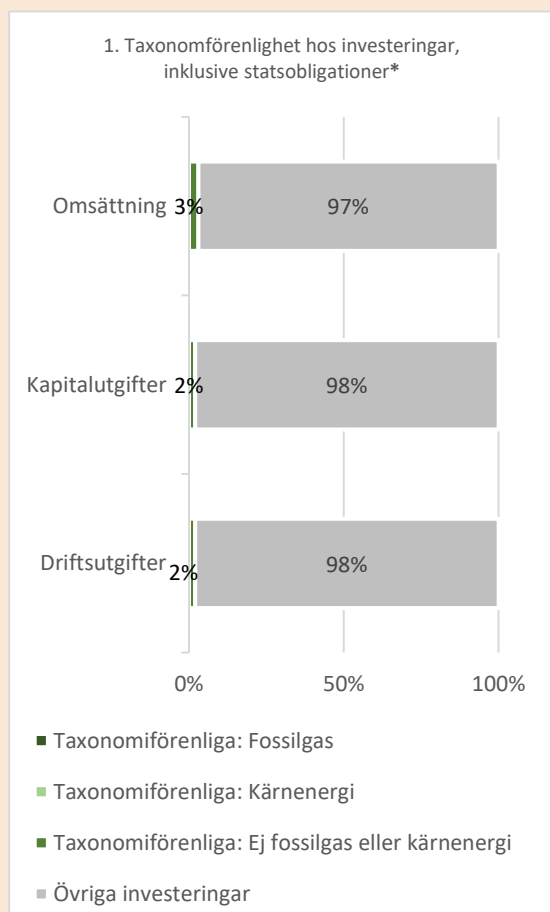
Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]

[Inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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.



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 4 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 7 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden uteslutande placerat i sådana fonder som främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

fonder som hade *hållbara investeringar som mål* och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### **Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?**

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.



**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-taxonomi** 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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza Auto 3

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0009779671

# Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_%

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



## I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt? [räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]

*[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Auto 3 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden främst placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, främst placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment* ("PRI") samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden i möjligaste mån valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

### ● Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Fonden hade vid inledningen av 2023 och under en begränsad påföljande period ett innehav i Amundi Index Global Agg. Amundi Index Global Agg är en räntefond som avkastningsmässigt har levererat i linje med Fondbolagets förväntningar, men inte vad gäller Fondbolagets strävan att företrädesvis placera i fonder som lever upp till artikel 8 och/eller artikel 9 i Disclosureförordningen. Innehavet i Amundi Index Global Agg byttes den 9 februari 2023 ut mot ett innehav i Amundi Global Agg SRI som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosureförordningen. Efter att Amundi Index Global Agg bytts ut mot Amundi Global Agg SRI har Fondens innehav uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till antingen artikel 8 och/eller artikel 9 i Disclosureförordningen.

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

*Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag*

Genom Fondens innehav i Amundi Index Global Agg har Fondbolaget konstaterat att Fonden indirekt under en begränsad period 2023 kan ha kommit att exponeras mot bolag som inte lever upp till FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. Genom Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI, en fond som tillämpar en screening för att identifiera bolag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag bedöms risken för att Fonden exponeras mot bolag som inte lever upp till FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag ha begränsats.

*Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot kontroversiella vapen/kärnvapen.

*Andel av intäkter från tobaksproduktion*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från tobaksproduktion.

*Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från spelverksamhet (gambling).

*Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från produktion av pornografiskt material.

*Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas).

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Resultatet av hållbarhetsindikatorerna förbättrades jämfört med resultatet för föregående period genom Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI. Efter bytet, som genomfördes den 9 februari 2023, har samtliga Fondens innehav utgjort fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har varit placerat dess medel i under perioden.

- Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

- Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

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

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*I EU-taxomin fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxominns mål, och åtföljs av särskilda unionskriterier.*

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.*



### **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i under perioden. Fonden har undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                           | Sektor | % tillgångar | Land    |
|---|--------|--------------|---------|
| Captor Iris Bond A<br>(SE0012204758)              | N/A    | 20,08%       | Sverige |
| Captor Aster Global<br>Credit A<br>(SE0015243878) | N/A    | 14,37%       | Sverige |
| Swedbank Robur Access<br>USA A<br>(SE0007074083)  | N/A    | 8,27%        | Sverige |
| Storebrand USA A<br>(SE0000594111)                | N/A    | 8,17%        | Sverige |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

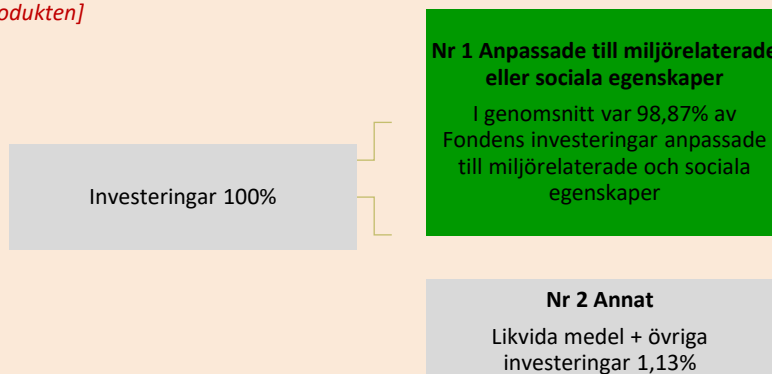
Fonden placerade under perioden huvudsakligen i fonder som *främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som hade *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden hade inget åtagande att göra hållbara investeringar.

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör noteras att Fondens genomsnittliga investeringar i fonder som antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* under perioden (81,16 procent) har underskridit den planerade andelen för sådana fonder och som kommuniceras i förköpsinformationen (90 procent). Förklaringen till detta är det innehav i Amundi Index Global Agg som Fonden haft under perioden. I samband med att Fonden byter innehavet i Amundi Index Global Agg mot Amundi Index Global Agg SRI under Q1 2023 kommer Fondens investeringar uteslutande utgöras av fonder som antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* och i övrigt möter de hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Det bör även understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 19,8%        |
| Industri                      | 17,7%        |
| Finans                        | 14,7%        |
| Hälsovård                     | 12,4%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,1%        |
| Telekommunikation             | 7,0%         |
| Fastigheter                   | 6,3%         |
| Dagligvaror                   | 6,1%         |
| Material                      | 4,5%         |
| Kraftförsörjning              | 1,3%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?

*[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

*[inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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.

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

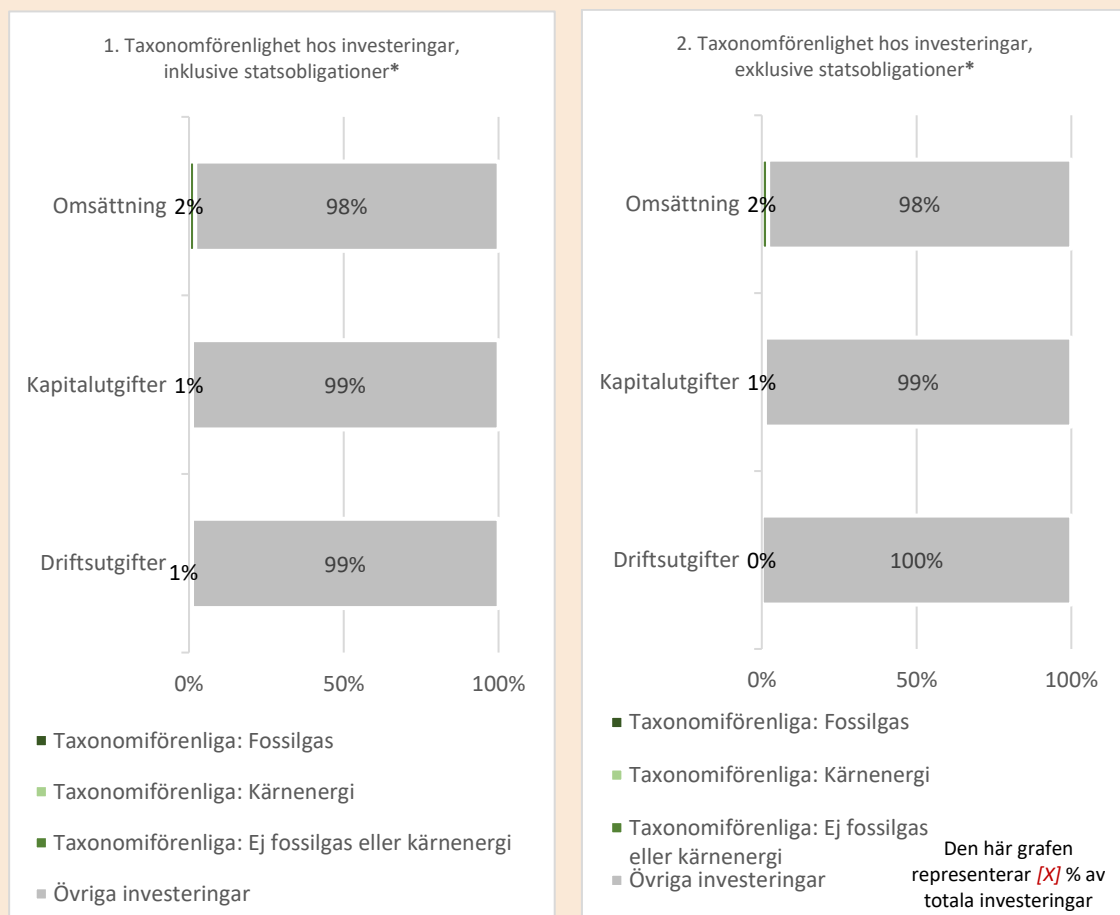
I kärnenergi

Nej



Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 3 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 4 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått. Övriga investeringar har utgjorts av sådana fonder som varken främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål enligt Disclosureförordningen.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden främst

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

placerat i sådana fonder som *främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som hade *hållbara investeringar som mål* och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

**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-taxonomi** 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 taxonomi eller inte.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

Produktnamn: Avanza 50

Identifieringskod för juridiska personer: SE0004841567

# Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **hållbara investeringar med ett miljömål:** \_\_\_%

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

Den gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_%

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel på \_\_\_% hållbara investeringar

- med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomi
- med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU-taxonomi
- med ett socialt mål

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



## I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt? [räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]

[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]

Avanza 50 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, enbart placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment* ("PRI") samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

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

### ● Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Resultatet har, genom att Fondens placeringar under perioden uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till kraven i artikel 8 och/eller 9 i Disclosureförordningen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som säkerställer efterlevnad av internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobaksproduktion

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från tobak, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från spelverksamhet, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från pornografiskt material, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter som överstiger 5 procent från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har varit placerad i under perioden.

*Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklARATION om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*I EU-taxomin fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomin må, och åtföljs av särskilda unionskriterier.*

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.*

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



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i under perioden. Fonden har undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.





## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                            | Sektor | % tillgångar | Land      |
|--|--------|--------------|-----------|
| Swedbank Robur Räntefond Kort A (SE0000543043)     | N/A    | 12,16%       | Sverige   |
| Öhman Obligationsfond (SE0006338398)               | N/A    | 12,15%       | Sverige   |
| Danske Invest Sverige Kort Ränta SA (LU1349496940) | N/A    | 11,77%       | Luxemburg |
| Storebrand Obligation A SEK (SE0000522518)         | N/A    | 10,84%       | Sverige   |
| Swedbank Robur Acess Global A (SE0007074059)       | N/A    | 9,29%        | Sverige   |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

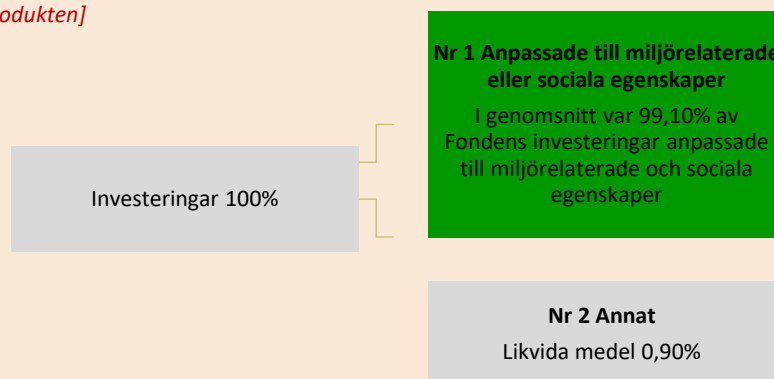
Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering har utgjorts av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som lever upp till kraven i artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

**Tillgångsalloker**  
**ing** beskriver  
andelen  
investeringar i  
specifika  
tillgångar.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 20,5%        |
| Finans                        | 18,2%        |
| Industri                      | 14,8%        |
| Hälsovård                     | 11,5%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,6%        |
| Telekommunikation             | 7,1%         |
| Dagligvaror                   | 6,1%         |
| Material                      | 5,3%         |
| Fastigheter                   | 4,2%         |
| Kraftförsörjning              | 1,7%         |
| Energi                        | 0,1%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?

*[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

### Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

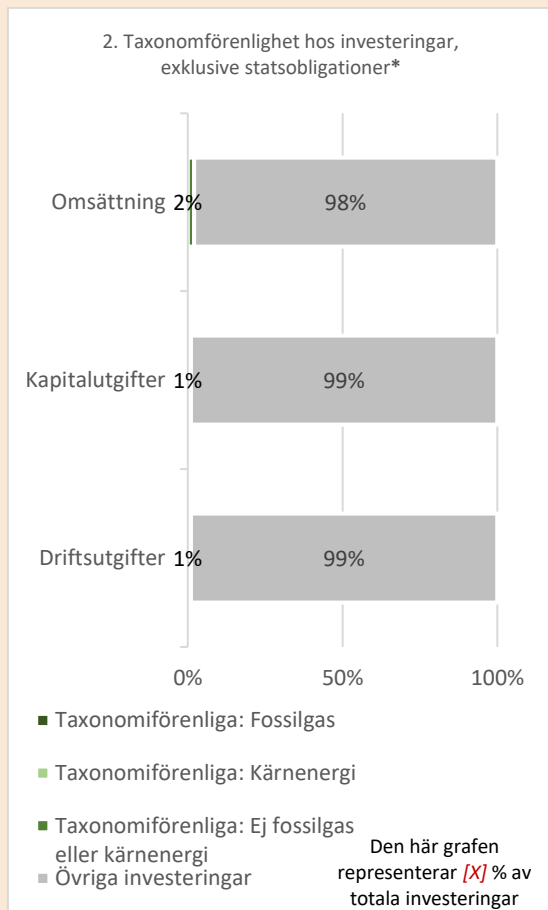
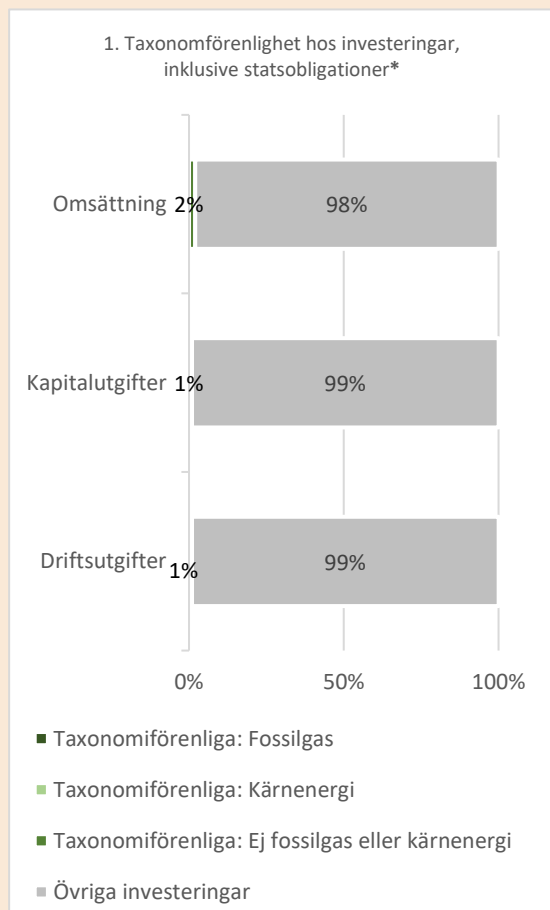
Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]

[Inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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 investeringsobjekt en, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi.
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

● **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 3 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 4 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden uteslutande placerat i sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

fonder som har *hållbara investeringar som mål* och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

## 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-taxonomi 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 taxonomi eller inte.

## BILAGA IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

Produktnamn: Avanza 75

Identifieringskod för juridiska personer: SE0004841534

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorde **hållbara investeringar med ett miljömål: \_\_\_%**

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

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

Den gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%**

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel på \_\_\_% hållbara investeringar

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

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

med ett socialt mål

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men gjorde inte några hållbara investeringar**





**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza 75 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, enbart placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment ("PRI")* samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

#### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

*Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål*

Resultatet har, genom att Fondens placeringar under perioden uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till kraven i artikel 8 och/eller 9 i Disclosureförordningen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

*Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag*

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som säkerställer efterlevnad av internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

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

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobaksproduktion

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från tobak, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från spelverksamhet, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från pornografiskt material, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter som överstiger 5 procent från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*

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



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i under perioden. Fonden har undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris Aligned Benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                                  | Sektor | % tillgångar | Land      |
|--|--------|--------------|-----------|
| Amundi IS MSCI World SRI PAB I13 SK C (LU2059755277)     | N/A    | 18,30%       | Luxemburg |
| Handelsbanken Global Index Criteria A SEK (SE0011309707) | N/A    | 18,03%       | Sverige   |
| Swedbank Robur Access Global A (SE0007074059)            | N/A    | 17,84%       | Sverige   |



**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

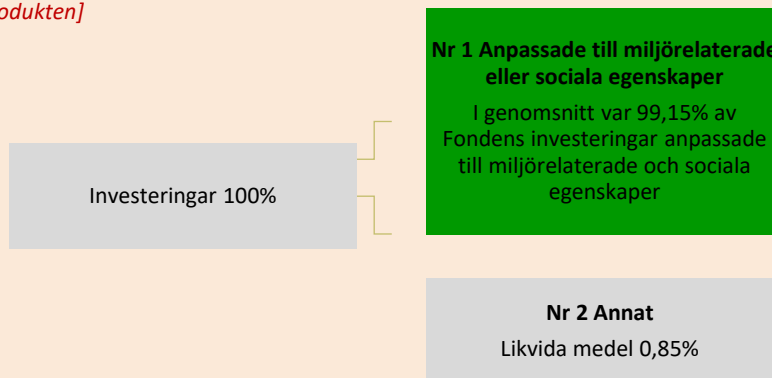
## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar.

### ● **Vad var tillgångsallokeringen?**

Fondens tillgångsallokering har utgjorts av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som lever upp till kraven i artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 22,3%        |
| Finans                        | 15,4%        |
| Industri                      | 14,5%        |
| Hälsovård                     | 13,3%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,3%        |
| Telekommunikation             | 7,3%         |
| Dagligvaror                   | 6,2%         |
| Material                      | 4,6%         |
| Fastigheter                   | 4,4%         |
| Kraftförsörjning              | 1,7%         |
| Energi                        | 0,1%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin? *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel*

*6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

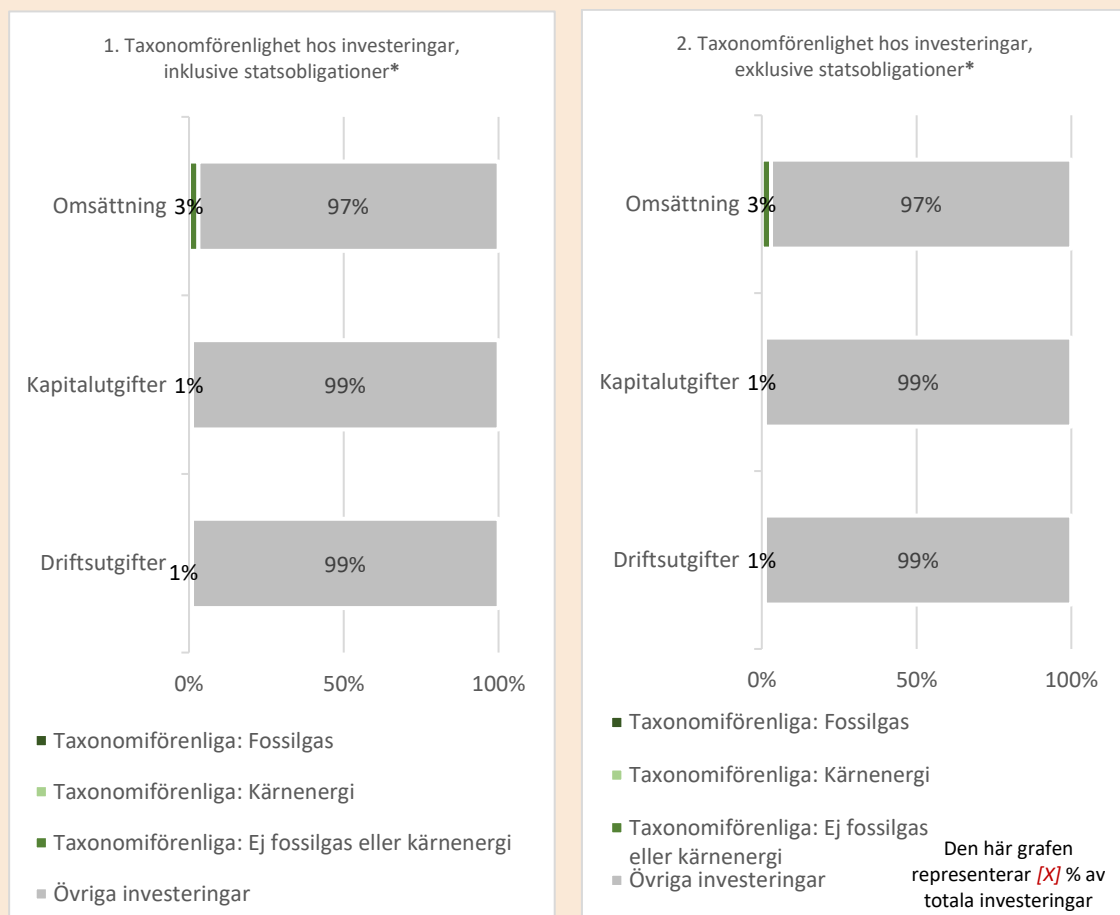
*[inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

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.

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per den 31 december 2023 emellertid 4 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 6 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.



- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden uteslutande placerat i sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

**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-taxonomi 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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

Produktnamn: Avanza Auto 5

Identifieringskod för juridiska personer: SE0009779697

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorda **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 gjorda **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_%

Den främjade **miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Auto 5 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden främst placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, främst placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment ("PRI")* samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

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

● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Resultatet har, genom att Fondens placeringar under perioden uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till kraven i artikel 8 och/eller 9 i Disclosureförordningen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som säkerställer efterlevnad av internationella normer och konventioner såsom FN Global

Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobaksproduktion

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från tobak, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från spelverksamhet, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från pornografiskt material, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter som överstiger 5 procent från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Resultatet av hållbarhetsindikatorerna förbättrades jämfört med resultatet för föregående period genom att Fonden under föregående period hade ett innehav i Amundi Index Global Agg. Nämnda fond utgjorde inte en fond som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* alternativt fond som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Innehavet i Amundi Index Global Agg byttes i december 2022 mot ett motsvarande innehav i Amundi Global Agg SRI. Efter bytet, som genomfördes under december 2022, har samtliga Fondens innehav, utgjort fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som

antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel under perioden.

*Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

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

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*



### **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades*

*huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i under perioden. Fonden har undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                            | Sektor | % tillgångar | Land      |
|--|--------|--------------|-----------|
| Storebrand USA A SEK (SE0000594111)                | N/A    | 12,58%       | Sverige   |
| Swedbank Robur Access USA A (SE0007074083)         | N/A    | 12,53%       | Sverige   |
| Amundi IS MSCI USA SRI PAB I13 SK C (LU2059754973) | N/A    | 12,40%       | Luxemburg |
| Swedbank Robur Access Edge Japan A (SE0007074091)  | N/A    | 6,53%        | Sverige   |
| Humble Småbolagsfond (SE0002229658)                | N/A    | 6,01%        | Sverige   |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har under perioden huvudsakligen placerat i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden hade inget åtagande att göra hållbara investeringar.

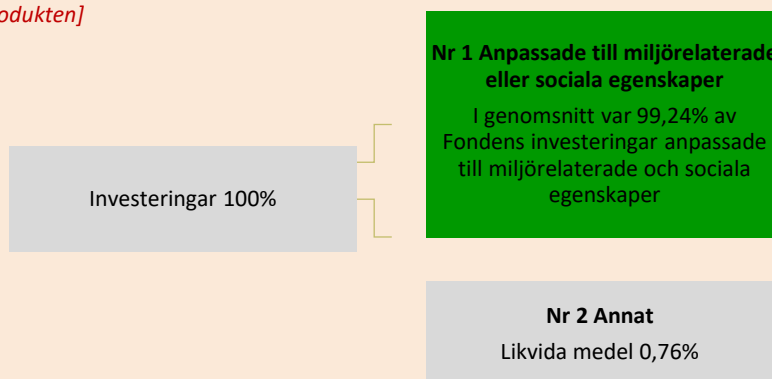
### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.



[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 19,0%        |
| Industri                      | 17,1%        |
| Finans                        | 16,0%        |
| Hälsovård                     | 12,0%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 9,9%         |
| Telekommunikation             | 7,2%         |
| Fastigheter                   | 6,4%         |
| Dagligvaror                   | 6,1%         |
| Material                      | 4,9%         |
| Kraftförsörjning              | 1,3%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel*

*6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel under perioden.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

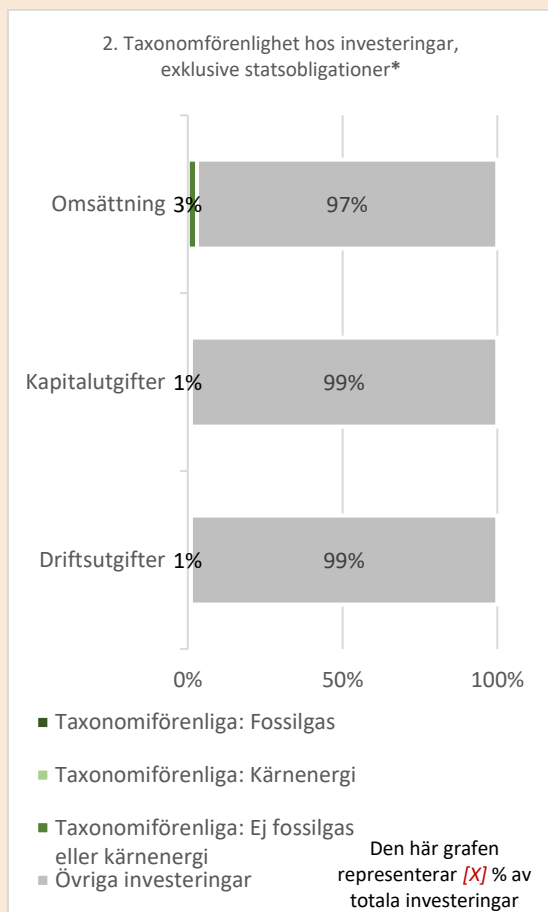
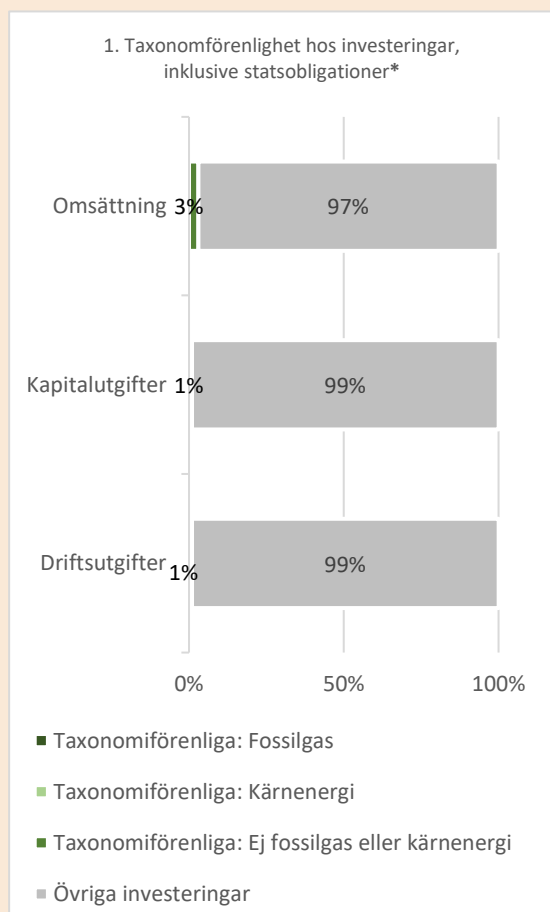
Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]

[Inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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.



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

● **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 4 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 6 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden främst placerat i sådana fonder som främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som hade hållbara investeringar som mål och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

**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-taxonomi** 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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza Auto 2

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0009779663

# Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_\_%

Den främjade **miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Auto 2 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden främst placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, främst placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment ("PRI")* samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden i möjligaste mån valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

#### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Fonden hade vid inledningen av 2023 och under en påföljande begränsad period ett innehav i Amundi Index Global Agg. Amundi Index Global Agg är en räntefond som avkastningsmässigt levererat i linje med Fondbolagets förväntningar, men inte vad gäller Fondbolagets strävan att företrädesvis placera i fonder som lever upp till artikel 8 och/eller artikel 9 i Disclosureförordningen. Innehavet i Amundi Index Global Agg byttes den 9 februari 2023 ut mot ett innehav i Amundi Global Agg SRI som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosureförordningen. Efter att Amundi Index Global Agg bytts ut mot Amundi Global Agg SRI har Fondens innehav uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till antingen artikel 8 och/eller artikel 9 i Disclosureförordningen.

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

*Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag*

Genom Fondens innehav i Amundi Index Global Agg har Fondbolaget konstaterat att Fonden indirekt kan ha kommit att exponeras mot bolag som inte lever upp till FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. Genom Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI, en fond som tillämpar en screening för att identifiera bolag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag bedöms risken för att Fonden exponeras mot bolag som inte lever upp till FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag ha begränsats.

*Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot kontroversiella vapen/kärnvapen.

*Andel av intäkter från tobaksproduktion*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från tobaksproduktion.

*Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från spelverksamhet (gambling).

*Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från produktion av pornografiskt material.

*Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas).

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Resultatet av hållbarhetsindikatorerna förbättrades jämfört med resultatet för föregående period genom Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI. Efter bytet, som genomfördes den 9 februari 2023, har samtliga Fondens innehav utgjort fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen.



- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

- Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

- Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

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



*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*

### **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i. Fonden har under perioden undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                             | Sektor | % tillgångar | Land      |
|---|--------|--------------|-----------|
| Amundi IS Global Agg<br>Ī13 HSK C<br>(LU2562901038) | N/A    | 19,94%       | Luxemburg |
| AMF Räntefond Mix<br>(SE0004324424)                 | N/A    | 19,77%       | Sverige   |
| Captor Iris Bond A<br>(SE0012204758)                | N/A    | 16,61%       | Sverige   |



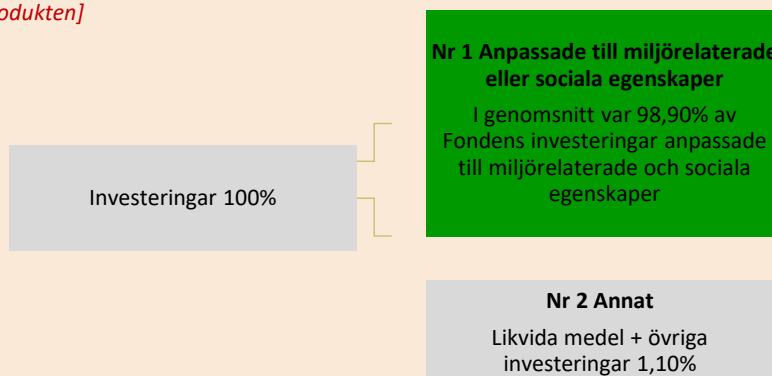
## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden placerade under perioden huvudsakligen i fonder som *främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som hade *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden hade inget åtagande att göra hållbara investeringar.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör noteras att Fondens genomsnittliga investeringar i fonder som antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* under perioden (78,61 procent) har underskridit den planerade andelen för sådana fonder och som kommuniceras i förköpsinformationen (80 procent). Förklaringen till detta är det innehav i Amundi Index Global Agg som Fonden haft under perioden. I samband med att Fonden byter innehavet i Amundi Index Global Agg mot Amundi Index Global Agg SRI under Q1 2023 kommer Fondens investeringar uteslutande utgöras av fonder som antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* och i övrigt möter de hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Det bör även understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

- **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna? Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.**

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 19,2%        |
| Finans                        | 16,6%        |
| Industri                      | 15,9%        |
| Hälsovård                     | 12,1%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,2%        |
| Telekommunikation             | 7,4%         |
| Dagligvaror                   | 6,1%         |
| Fastigheter                   | 6,0%         |
| Material                      | 5,1%         |
| Kraftförsörjning              | 1,4%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



### I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?

*[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

#### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

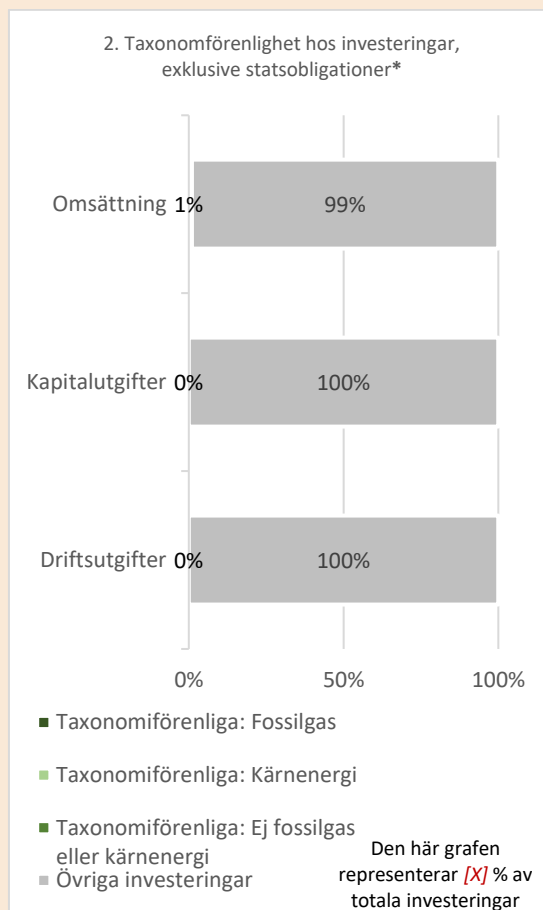
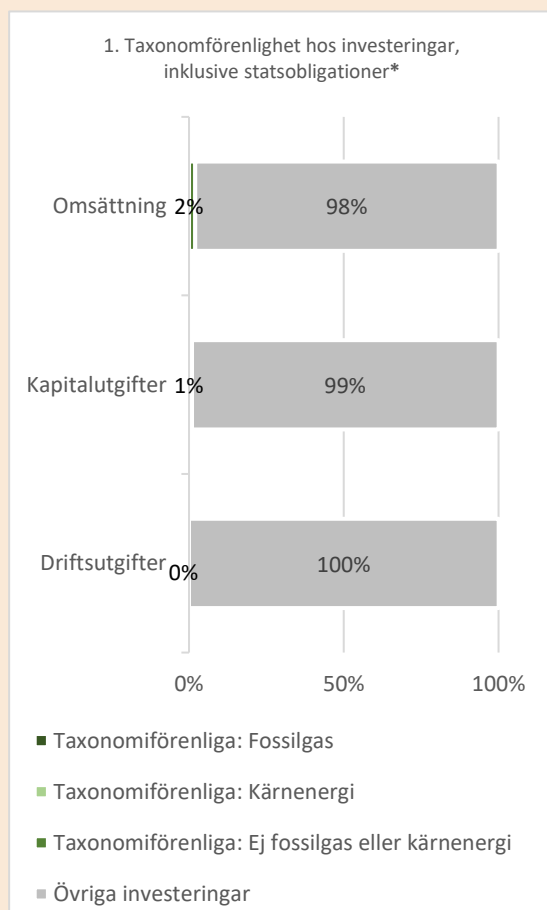
Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]

[Inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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.



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställnings- verksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 2 procent av Fondens värde placeringar i omställnings- verksamheter och 4 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



### **Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?**

[inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



### **Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



### **Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått. Övriga investeringar har utgjorts av sådana fonder som varken främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål enligt Disclosureförordningen.



### **Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

*den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden främst placerat i sådana fonder som *främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som hade *hållbara investeringar som mål* och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.

*[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]*



### **Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?**

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

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



## 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-taxonomi** 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 taxonomi eller inte.

## BILAGA IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

Produktnamn: Avanza Auto 1

Identifieringskod för juridiska personer: SE0009779655

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorde **hållbara investeringar med ett miljömål: \_\_\_%**

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

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

Den gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%**

Den främjade **miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel på \_\_\_% hållbara investeringar

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

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

med ett socialt mål

Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** [räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]

Avanza Auto 1 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden främst placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, främst placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment* ("PRI") samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden i möjligaste mån valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

#### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Fonden hade vid inledningen av 2023 och under en påföljande begränsad period ett innehav i Amundi Index Global Agg. Amundi Index Global Agg är en räntefond som avkastningsmässigt levererat i linje med Fondbolagets förväntningar, men inte vad gäller Fondbolagets strävan efter att företrädesvis placera i fonder som lever upp till artikel 8 och/eller artikel 9 i Disclosureförordningen. Innehavet i Amundi Index Global Agg byttes den 9 februari 2023 ut mot ett innehav i Amundi Global Agg SRI som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosureförordningen. Efter att Amundi Index Global Agg bytts ut mot Amundi Global Agg SRI har Fondens innehav uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till antingen artikel 8 och/eller artikel 9 i Disclosureförordningen.

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

*Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag*

Genom Fondens innehav i Amundi Index Global Agg har Fondbolaget konstaterat att Fonden indirekt och under en begränsad period 2023 kan ha kommit att exponeras mot bolag som inte lever upp till FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. Genom Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI, en fond som tillämpar screening för att identifiera bolag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, bedöms risken för att Fonden exponeras mot bolag som inte lever upp till FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag ha begränsats.

*Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot kontroversiella vapen/kärnvapen.

*Andel av intäkter från tobaksproduktion*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från tobaksproduktion.

*Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från spelverksamhet (gambling).

*Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från produktion av pornografiskt material.

*Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)*

Resultatet har under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier. Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI bedöms ha medfört en ytterligare begränsning av risken för att Fonden exponeras mot företag med intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas).

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Resultatet av hållbarhetsindikatorerna förbättrades jämfört med resultatet för föregående period genom Fondens byte av Amundi Index Global Agg mot Amundi Global Agg SRI. Efter bytet, som genomfördes den 9 februari 2023, har samtliga Fondens innehav utgjorts av fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** *[inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering.*

*För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden placerat dess medel i under perioden.

***Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden placerat dess medel i under perioden.

***Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden placerat dess medel i under perioden.

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

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*



## **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i. Fonden har under perioden undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör den finansiella produktens största andel investeringar under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                           | Sektor | % tillgångar | Land      |
|---|--------|--------------|-----------|
| AMF Räntefond Mix (SE0004324424)                  | N/A    | 16,43%       | Sverige   |
| Amundi IS Global Agg SRI I13 HSK C (LU2562901038) | N/A    | 16,43%       | Luxemburg |
| Öhman Obligationsfond SEK A (SE0006338398)        | N/A    | 9,79%        | Sverige   |
| Storebrand Obligation A (SE0000522518)            | N/A    | 9,66%        | Sverige   |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

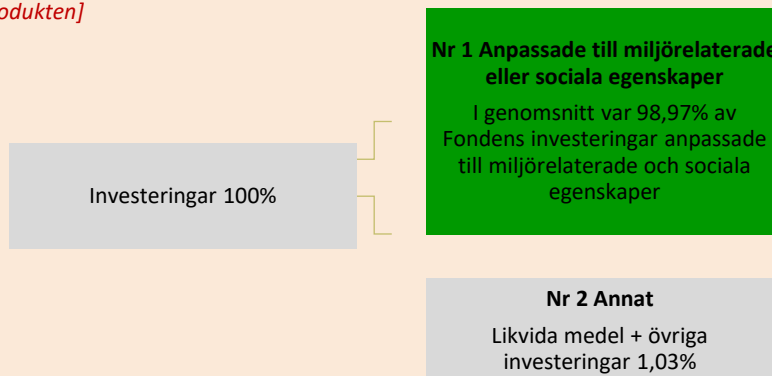
Fonden placerade under perioden huvudsakligen i fonder som *främjade miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som hade *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden hade inget åtagande att göra hållbara investeringar.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 20,1%        |
| Finans                        | 15,8%        |
| Industri                      | 15,7%        |
| Hälsovård                     | 12,4%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,3%        |
| Telekommunikation             | 7,5%         |
| Dagligvaror                   | 6,4%         |
| Fastigheter                   | 5,6%         |
| Material                      | 4,8%         |
| Kraftförsörjning              | 1,5%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxid snåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

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

**Omställningsverksamheter** är verksamheter som det ännu inte finns koldioxid snåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden placerat dess medel i under perioden.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

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

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

- **omsättning**, vilket återspeglar andelen av intäkterna från investeringsobjektens gröna verksamheter

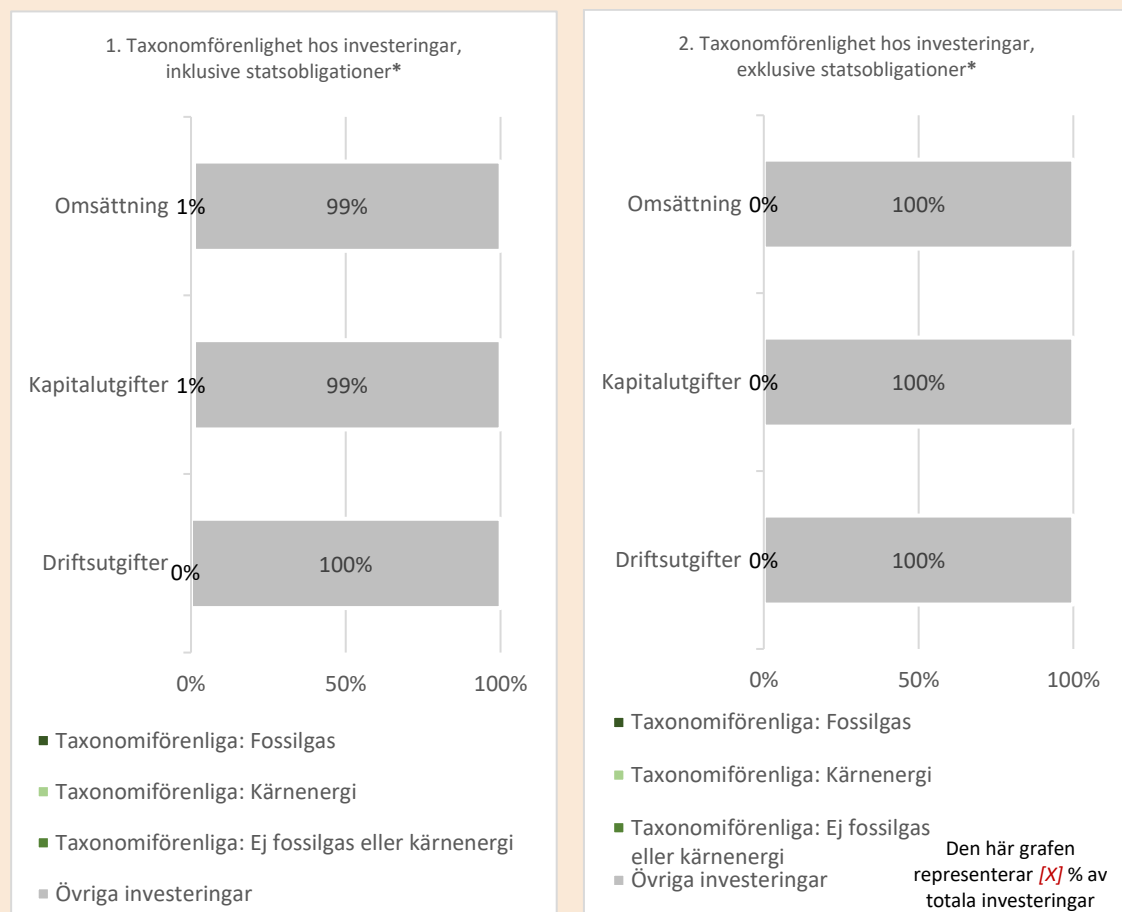
- **kapitalutgifter**, som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjektet, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi.

- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per den 31 december 2023 emellertid 1 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 3 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått. Övriga investeringar har utgjorts av sådana fonder som varken främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål enligt Disclosureförordningen.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden främst

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

placerat i sådana fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[Inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

**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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza 100

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0004841526

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_%

Den främjade **miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** [räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]

Avanza 100 ("Fonden") är en fondandelsfond. Genom de särskilda hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt i *Instruktion för ansvarsfulla investeringar* har Fonden beaktat hållbarhetsrisker liksom främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden placerat i så kallade ljus- eller mörkgröna fonder, det vill säga valt in sådana fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål enligt artiklarna 8 eller 9 i EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"). Fonden har därtill, i linje med fastställda hållbarhetskriterier, enbart placerat i fonder vars förvaltning är utformad enligt *Principles for Responsible Investment* ("PRI") samt omfattas av en policy för ansvarsfulla investeringar och aktieägarengagemang.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i fonder som i sin tur placerar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag (åtminstone företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem)

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden gentemot de fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Påverkansarbetet har syftat till att, där det bedömts funnits möjlighet, styra fondbolagen mot en mer hållbar inriktning och minska inslagen av hållbarhetsrisker och främja en hållbar utveckling.

#### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel placeringar i fonder som enligt Disclosureförordningen klassificerats som fonder som främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper respektive fonder som har hållbara investeringar som mål

Resultatet har, genom att Fondens placeringar under perioden uteslutande utgjorts av fonder som lever upp till kraven i artikel 8 och/eller 9 i Disclosureförordningen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som säkerställer efterlevnad av internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

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

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobaksproduktion

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från tobak, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från spelverksamhet, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion av pornografiskt material

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter från produktion som överstiger 5 procent från pornografiskt material, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas)

Resultatet har, genom att Fonden under perioden uteslutande placerat i fonder som i sin tur inte placerar i företag med intäkter som överstiger 5 procent från produktion/utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** *[inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Däremot kan Fonden, genom dess övergripande strävan efter att placera i sådana fonder som antingen främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper eller fonder som har hållbara investeringar som mål kommit att erhålla en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna ämnar bidra till fastställs och redovisas i sådant fall av de utomstående fondbolag som förvaltar de fonder Fonden placerat i. Genom att Fonden placerar i fonder vars placeringsinriktningar liksom placeringsstrategier skiljer sig åt kan såväl målen för, och de bidrag de eventuella hållbara investeringarna ger till miljömålen, skilja sig åt.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Detta analyseras och redovisas av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

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

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.*

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



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden och som utgjort en ram för vilka fonder Fonden haft möjlighet att placera i under perioden. Fonden har undvikit att placera i fonder som i sin tur placerar i vissa verksamheter såsom tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen och fossila bränslen (kol, olja, gas – åtminstone termiskt kol samt okonventionell olja och gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom att Fonden valt bort fonder med exponering mot företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från produktion/utvinning av fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser. På samma sätt innebär Fondens placeringar i fonder som förvaltas i syfte att efterbilda så kallade *Paris-aligned benchmarks* ("PAB") en begränsad påverkan på PAI-indikatorer såsom koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                                  | Sektor | % tillgångar | Land      |
|--|--------|--------------|-----------|
| Swedbank Robur Access Global A (SE0007074059)            | N/A    | 18,37%       | Sverige   |
| Amundi IS MSCI World SRI PAB I13 SK C (LU2059755277)     | N/A    | 18,15%       | Luxemburg |
| Handelsbanken Global Index Criteria A SEK (SE0011309707) | N/A    | 17,87%       | Sverige   |





## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har under året uteslutande placerat i fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* eller fonder som har *hållbara investeringar som mål* enligt artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen. Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar.

### Tillgångsalloker

ing beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

#### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering har utgjorts av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i fonder som lever upp till kraven i artiklarna 8 eller 9 i Disclosureförordningen samt möter övriga hållbarhetskriterier som fastställts för Fonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolagets bedömning utgår från Fondens placeringar i fonder och inte fondernas underliggande placeringar. För information om tillgångsallokeringen i de underliggande fonderna se information som tillhandahålls av respektive fondbolag.

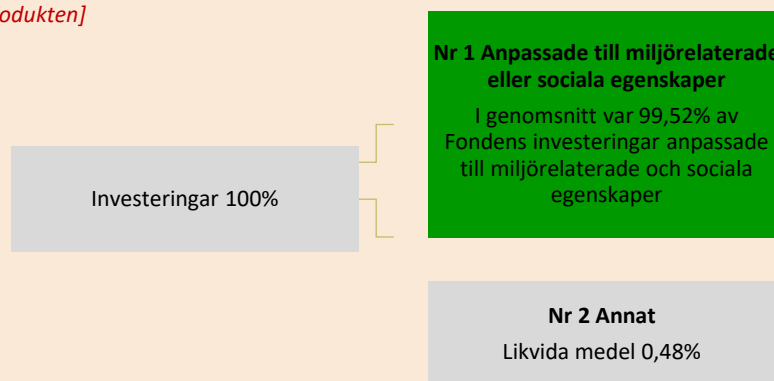
[Inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

- **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 20,6%        |
| Finans                        | 18,1%        |
| Industri                      | 14,6%        |
| Hälsovård                     | 11,5%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,7%        |
| Telekommunikation             | 7,1%         |
| Dagligvaror                   | 6,1%         |
| Material                      | 5,2%         |
| Fastigheter                   | 4,1%         |
| Kraftförsörjning              | 1,7%         |
| Energi                        | 0,1%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.



### I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?

*[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. För vissa av de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid finnas ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av de hållbara investeringarnas förenlighet med EU-taxonomin av det fondbolag vars fond har genomfört hållbara investeringar och Fonden placerat dess medel i under perioden.

#### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

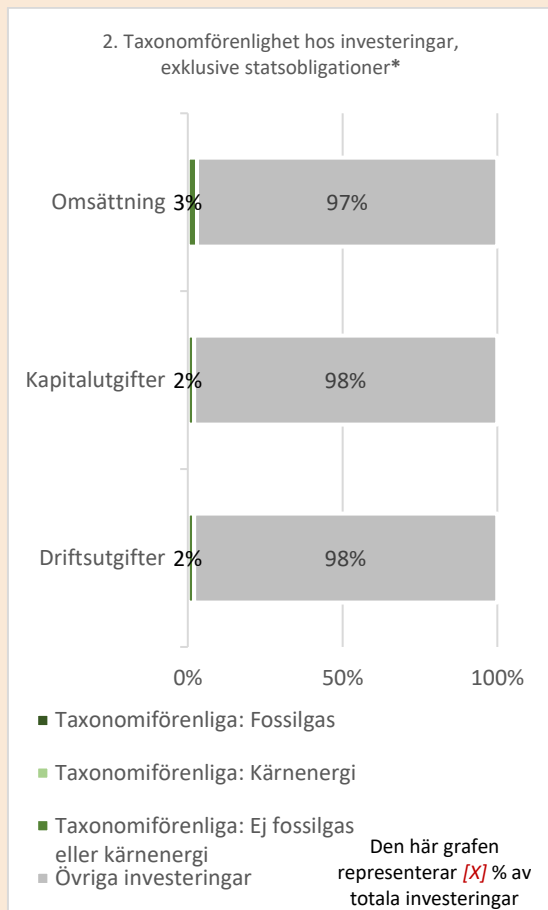
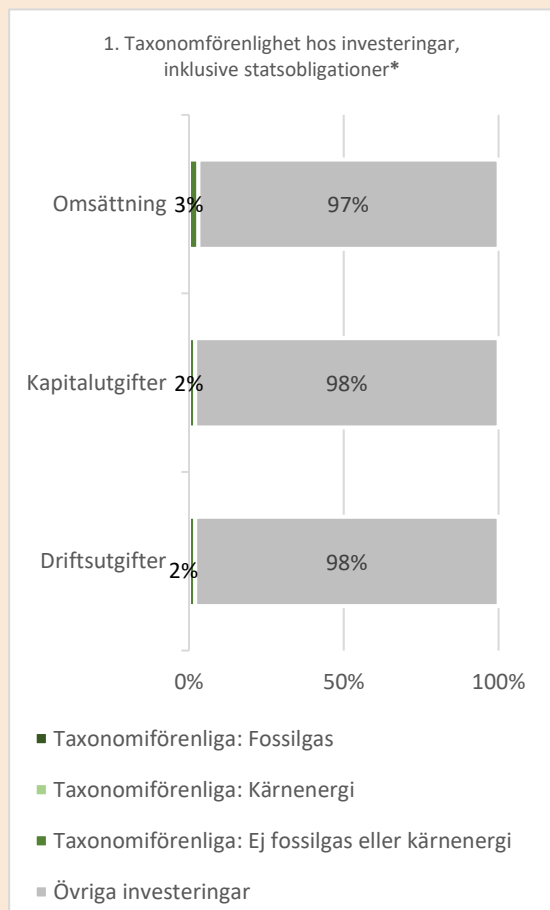
Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]

[Inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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 investeringsobjekt en, t.ex. för en omställning till en grön ekonomi.
- **driftsutgifter**, som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

● **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [Inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 5 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 8 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** *[inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.

*[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]*



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



är

hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt förordning (EU) 2020/852.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** *[inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar. För de fonder som Fonden placerat i kan det emellertid ha funnits ett sådant åtagande. I sådant fall genomförs analys och redovisning av det fondbolag vars fond har genomfört sådana investeringar och Fonden har placerat dess medel i under perioden.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** *[räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]*

Fonden har under perioden uteslutande placerat i fonder. För de fonder som Fonden kan placera i har särskilda hållbarhetskriterier fastställts. Fonden har under perioden uteslutande placerat i sådana fonder som *främjar miljörelaterade och/eller sociala egenskaper* respektive fonder som har *hållbara investeringar som mål* och i övrigt har levt upp till Fondens hållbarhetskriterier. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp de underliggande fonderna för att

säkerställa att de lever upp till Fondens hållbarhetskriterier. För det fall en underliggande fond inte levt upp till hållbarhetskriterierna har dialoger förts med det förvaltande fondbolaget och som en sista åtgärd har beslut fattats om avyttring av innehavet.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

**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.

## BILAGA IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

**Produktnamn:** Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest  
**Identifikationskod för juridiska personer:** SE0019176488

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_%

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



## I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt? *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

*[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Disruptive Innovation by ARK Invest ("Fonden") är en aktiefond som placerar i aktier utgivna av innovativa bolag inom olika branscher över hela världen med tyngdpunkt på amerikanska bolag.

Genom de hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt för Fonden har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper liksom beaktat hållbarhetsrisker under perioden.

Fonden har under perioden valt in sådana företag som bedöms främja hållbara egenskaper, exempelvis teknologier och sådana företag som sannolikt kommer att ha en positiv påverkan på miljö och samhälle. Fokus ligger på företag som är ledare, möjliggörare respektive företag som drar nytta av så kallad "disruptive innovation", det vill säga branschomvälvande innovation. ARK Invests forskning har identifierat olika tekniker som ligger bakom fem stora innovationsplattformar, vilka anses kunna förändra världen och samtidigt linjera med FN:s globala mål för hållbar utveckling. De identifierade företagen ska även ha robusta styrningsstrukturer och produktuppsättningar med en positiv social och miljömässigt hållbar påverkan.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter som tobak, spelverksamhet (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag
- företag som är inblandade i betydande kontroverser (uppgåendes till 5 på Sustainalytics femgradiga skala över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle)

### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

#### Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

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



Andel av intäkter från spelverksamhet (gambling)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från spel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från pornografi, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Nivå på kontroverser i företagen enligt Sustainalytics femgradiga skala över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag som klassificerats som 5 på Sustainalytics femgradiga skala över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 27 januari 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

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

— — Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

— — Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? *Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

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

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.*



**Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Fonden har under perioden undvikit exponering mot verksamheter såsom bland annat, tobak, spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom Fondens exkluderingar av företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot

fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser.

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.

**Tillgångsalloker**  
**ing** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.



### Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

| Största investeringarna                          | Sektor            | % tillgångar | Land |
|--|-------------------|--------------|------|
| Tesla<br>(US88160R1014)                          | Sällanköpsvaror   | 8,93%        | USA  |
| Roku A<br>(US77543R1023)                         | Telekommunikation | 8,38%        | USA  |
| Zoom Video<br>Communications A<br>(US98980L1017) | Teknik            | 7,67%        | USA  |
| Coinbase Global A<br>(US19260Q1076)              | Finans            | 7,22%        | USA  |
| Block A<br>(US8522341036)                        | Teknik            | 5,66%        | USA  |
| UiPath A<br>(US90364P1057)                       | Teknik            | 4,55%        | USA  |
| Unity Software<br>(US91332U1016)                 | Teknik            | 4,20%        | USA  |
| Twilio A<br>(US90138F1021)                       | Telekommunikation | 3,90%        | USA  |

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230127-20231231. Fonden startade 2023-01-27 och siffran utgör ett genomsnitt av 4 kvartalsvisa mätperioder.



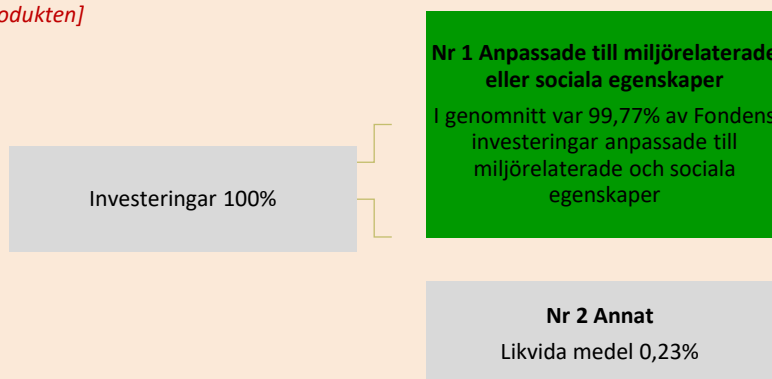
### Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har under perioden inte haft som målsättning att genomföra hållbara investeringar.

#### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra kvartalsvisa mätperioder under året.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 33,8%        |
| Hälsovård                     | 25,5%        |
| Telekommunikation             | 19,9%        |
| Finans                        | 12,3%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 7,5%         |
| Industri                      | 0,9%         |
| Dagligvaror                   | 0,1%         |
| Material                      | 0,0%         |
| Fastigheter                   | 0,0%         |
| Kraftförsörjning              | 0,0%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

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

Taxonomiförenliga  
verksamheter  
uttrycks som en  
andel av följande:  
- **omsättning**,  
vilket återspeglar  
andelen av  
intäkterna från  
investeringsobjekt  
ens gröna  
verksamheter  
- **kapitalutgifter**,  
som visar de gröna  
investeringar som  
gjorts av  
investeringsobjekt  
en, t.ex. för en  
omställning till en  
grön ekonomi.  
- **driftsutgifter**,  
som återspeglar  
investeringsobjekt  
ens gröna  
operativa  
verksamheter.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja [ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]

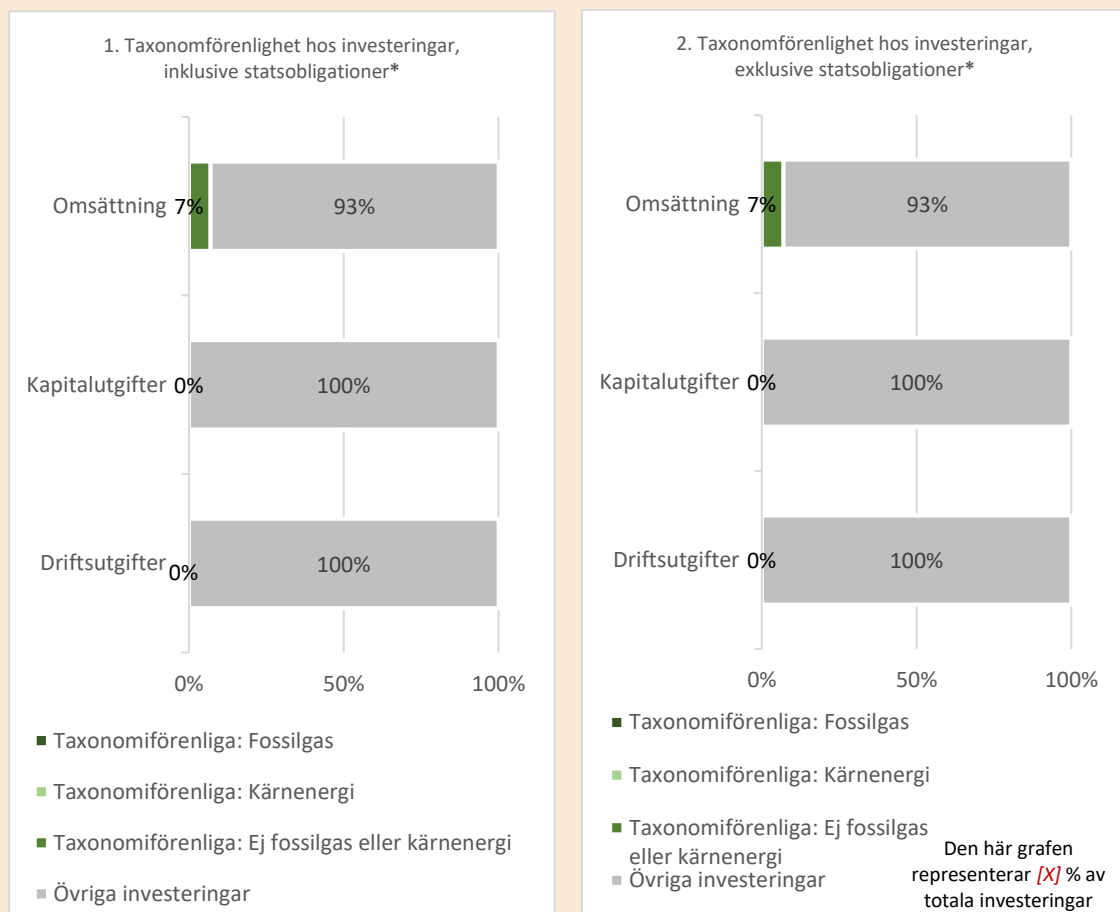
I fossilgas

I kärnenergi

Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställnings- verksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per den 31 december 2023 emellertid 14 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter. Fonden hade inte några placeringar i omställnings- verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 27 januari 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.



- **Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomi.



- **Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



- **Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.



### Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?

*[räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]*

Fonden har under perioden placerat dess medel i enlighet med de hållbarhetskriterier som fastställts för Fondens främjande av miljörelaterade och sociala egenskaper. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp Fondens investeringar för att säkerställa uppfyllnad av Fondens hållbarhetskriterier.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.



## Avanza Emerging Markets

### Transparens i fråga om integrering av hållbarhetsrisker, om negativa konsekvenser för hållbar utveckling, om främjandet av miljörelaterade eller sociala egenskaper, och om hållbar investering

- Fonden har hållbara investeringar som mål
- Fonden främjar bland annat miljörelaterade eller sociala egenskaper
- Hållbarhetsrisker integreras i investeringsbeslut, utan att fonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper eller har hållbar investering som mål
- Hållbarhetsrisker är inte relevanta (förklaring nedan)
- Huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktas
- Huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer är inte relevanta (motivering nedan)

#### Fondbolagets kommentar:

Avanza Emerging Markets är en matarfond som syftar till att vara fullinvesterad i mottagarfonden Amundi Index MSCI Emerging Markets ("Mottagarfonden"). Fonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer då Fondens målsättning är att vara fullinvesterad i Mottagarfonden som i sin tur har som målsättning att följa utvecklingen för dess jämförelseindex som inte integrerar hållbarhetsrisker eller bedöms beakta negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer i en vidare bemärkelse. Detta innebär att hållbarhetsrisker kan ha en betydande negativ inverkan på avkastningen för fonden.

### Information om EU:s taxonomi för miljömässigt hållbara verksamheter

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Denna fonds underliggande investeringar beaktar inte EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

### Metoder som används för att integrera hållbarhetsrisker, främja miljörelaterade eller sociala egenskaper eller för att uppnå ett hållbarhetsrelaterat mål:

#### Fonden väljer bort

Mottagarfonden 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

Klusterbomber, personminor

Fondbolagets kommentar:

Kemiska och biologiska vapen

Fondbolagets kommentar:

## Internationella normer

Internationella normer avser internationella konventioner, lagar och överenskommelser såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag som rör frågor om miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden investerar inte i bolag som kränker internationella normer. Bedömningen görs antingen av fondbolaget självt eller av en underleverantör.

Fondbolagets kommentar:

Fonden investerar inte i bolag som inte vidtar åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta med problemen under en tid som fondbolaget bedömer som rimlig i det enskilda fallet.

Detta alternativ avser fonder som tar fram en handlingsplan för ifrågasatta bolag, som exkluderas om angivna villkor inte uppfylls under utsatt tidsperiod.

Fondbolagets kommentar:

## Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Detta alternativ avser fonder som gör en landspecifik hållbarhetsanalys som resulterar i att bolag involverade i vissa länder exkluderas eller att räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater exkluderas.

Fondbolagets kommentar:

## Övrigt

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

**Fondbolaget påverkar**

Fondbolaget använder sitt inflytande för att påverka bolag i hållbarhetsrelaterade frågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Avser Mottagarfondbolaget Amundi Luxembourg S.A ("Amundi").

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Avser Mottagarfondbolaget Amundi.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Avser Mottagarfondbolaget Amundi.

## Uppföljning av hållbarhetsarbetet

### Information om EU:s taxonomi för miljömässigt hållbara verksamheter

EU-taxonomi är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Denna fonds underliggande investeringar beaktar inte EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

### Metoder som använts för att integrera hållbarhetsrisker, främja miljörelaterade eller sociala egenskaper eller för att uppnå ett hållbarhetsrelaterat mål:

#### Fonden har valt in

Avanza Emerging Markets är en matarfond som investerar i mottagarfonden Amundi Index MSCI Emerging Markets. Mottagarfonden har som mål att följa utvecklingen för sitt jämförelseindex och väljer därför inte aktivt in bolag.

#### Fonden har valt bort

Mottagarfonden exkluderar kontroversiella vapen, såsom klusterbomber, personminor, kemiska och biologiska vapen. Under året har Fondbolaget haft löpande avstämningar med Amundi. Av både samtal och från officiell information har vi säkerställt att fonden tillämpat exkluderingskriterierna.

#### Fonden har påverkat

Matarfonden Avanza Emerging Markets syftar till att vara fullinvesterad i mottagarfonden Amundi Index MSCI Emerging Markets. Mottagarfonden förvaltas av Amundi Luxembourg S.A ("Amundi"). Amundi har antagit principer för aktieägarengagemang som omfattar mottagarfonden och en årlig redogörelse publiceras på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

## Övergripande kommentar om hållbarhetsarbetet

Avanza Fonder har under 2023 fortsatt arbetet med att utveckla sin hållbarhetsstrategi. Avanza Fonder är sedan februari 2018 medlemmar i UNPRI, Principles for Responsible Investment och har under året genomfört en rapportering i enlighet med PRI:s principer och riktlinjer.

Under det gångna året har fortsatt stort fokus lagts på EU-regelverk inom hållbarhet såsom Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen") som började tillämpas den 10 mars 2021 och där nivå 2-regler började tillämpas den 1 januari 2023.

Under året har Avanza Fonder lanserat totalt fem nya fonder. Tre av dessa fonder utgör fonder som främjar miljörelaterade och sociala egenskaper i enlighet med artikel 8 i Disclosureförordningen samt två av fonderna utgör fonder som har hållbara investeringar som mål i enlighet med artikel 9 i Disclosureförordningen.

Avanza Fonder ser löpande över och arbetar med att utveckla sin hållbarhetsstrategi för samtliga fonder under dess förvaltning.

## 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-taxonomi 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.

## BILAGA IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

Produktnamn: Avanza Europa

Identifieringskod för juridiska personer: SE0013718699

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorda 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 gjorda hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%

Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men gjorde inte några hållbara investeringar



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Europa ("Fonden") är en matarfond som placerar i mottagarfonden Amundi Index MSCI Europe SRI PAB ("Mottagarfonden"). Mottagarfonden förvaltats i syfte att efterbilda sammansättningen av dess jämförelseindex. Mottagarfondens jämförelseindex är utformat så att det efterlever minimikraven i EU Paris-aligned benchmarks ("PAB"). Detta innebär bland annat att den vägda genomsnittliga växthusgasintensiteten, sammantaget för de företag som ingår i jämförelseindex, är reducerad till minst hälften av växthusgasintensiteten för företag i en referensportfölj. Därtill ska de företag som ingår i jämförelseindex sammantaget uppvisa en minskning av växthusgasintensitet motsvarande minst sju procent på årsbasis. Mottagarfondens jämförelseindex innehåller vidare de företag med högst *Environmental-, Social- och Governance* ("ESG")-betyg inom varje branschsektor och som därmed bedöms agera föredömligt vad gäller hantering av miljö-, sociala- och bolagsstyrningsrelaterade risker och möjligheter.

Genom Fondens placering i Mottagarfonden, liksom de ytterligare exkluderingskriterier som tillämpas för Mottagarfonden, har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Under perioden har Mottagarfonden *valt bort* placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med mer än 5 procents intäkter hänförliga till civila skjutvapen, konventionella vapen, GMO, kärnkraft och tobak
- företag med mer än 5 procents intäkter hänförliga till produktion/ägarskap av alkohol, pornografi, och spelverksamhet, där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning av nämnda verksamheter.
- företag med mer än 5 procents intäkter hänförliga till kolkraftproduktion
- företag med mer än 30 procents intäkter från olje- och gasbaserad kraftproduktion.
- företag med allvarliga ESG-relaterade kontroverser som uppgår till mellan 0 och 3 på en tiogradig betygsskala (där 0 är sämst respektive 10 bäst) över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle i enlighet med internationella normer och konventioner som FN:s allmänna förklaring om de mänskliga rättigheterna, ILO:s deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och FN:s Global Compact.

Mottagarfondens fondbolag, Amundi Luxembourg S.A ("Amundi"), har under perioden bedrivit ett påverkansarbete för Mottagarfondens räkning. För närmare information se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från civila skjutvapen, konventionella vapen och krigsmaterial

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från civila skjutvapen, konventionella vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från GMO

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från GMO, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från kärnkraft

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från kärnkraft, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från produktion/ägarskap av alkohol samt där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från produktion/ägarskap av pornografi samt där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från produktion/ägarskap av spel samt där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna bidrar till fastställs och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Detta analyseras och redovisas av Amundi. Detta analyseras och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

- — **Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?**

Detta analyseras och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

- — **Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:** [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]

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



Detta analyseras och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*



### **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Det är genom Fondens placering i Mottagarfonden och utformningen av Mottagarfondens jämförelseindex som hållbarhetskriterierna har implementerats. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna samt den exkluderingsstrategi som tillämpas för Mottagarfonden, undvikit exponering mot vissa verksamheter såsom, vapen, alkohol, tobak, kommersiell spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som är involverade i allvarliga ESG-relaterade kontroverser och som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Mottagarfondens jämförelseindex utgör vidare ett så kallat Paris-aligned benchmark. Genom utformningen av Mottagarfondens jämförelseindex har Fondens påverkan på PAI-indikatorer såsom utläpp av växthusgaser, koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet därtill begränsats. Amundi har för Mottagarfondens räkning bedrivit påverkansarbete under perioden i syfte att påverka företagen i miljörelaterade och sociala frågor, mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är av betydelse för samhället och den globala ekonomin.

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                         | Sektor | % tillgångar | Land      |
|---|--------|--------------|-----------|
| Amundi Index MSCI Europe SRI PAB (LU2059754890) | N/A    | 99,94%       | Luxemburg |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar under perioden.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i Mottagarfonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolaget i denna bedömning utgår från Fondens placering i Mottagarfonden (som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosureförordningen) och inte Mottagarfondens underliggande placeringar. För information om Mottagarfondens tillgångsallokering se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Industri                      | 19,0%        |
| Finans                        | 16,3%        |
| Dagligvaror                   | 15,2%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 11,5%        |
| Hälsovård                     | 10,3%        |
| Teknik                        | 10,3%        |
| Material                      | 6,9%         |
| Telekommunikation             | 4,6%         |
| Kraftförsörjning              | 3,9%         |
| Fastigheter                   | 2,1%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxid snåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

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

**Omställningsverksamheter** är verksamheter som det ännu inte finns koldioxid snåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

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

Taxonomiförenliga  
verksamheter  
uttrycks som en  
andel av följande:  
- **omsättning**,  
vilket återspeglar  
andelen av  
intäkterna från  
investeringsobjekt  
ens gröna  
verksamheter  
- **kapitalutgifter**,  
som visar de gröna  
investeringar som  
gjorts av  
investeringsobjekt  
en, t.ex. för en  
omställning till en  
grön ekonomi.  
- **driftsutgifter**,  
som återspeglar  
investeringsobjekt  
ens gröna  
operativa  
verksamheter.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?

[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergi relaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja [ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]

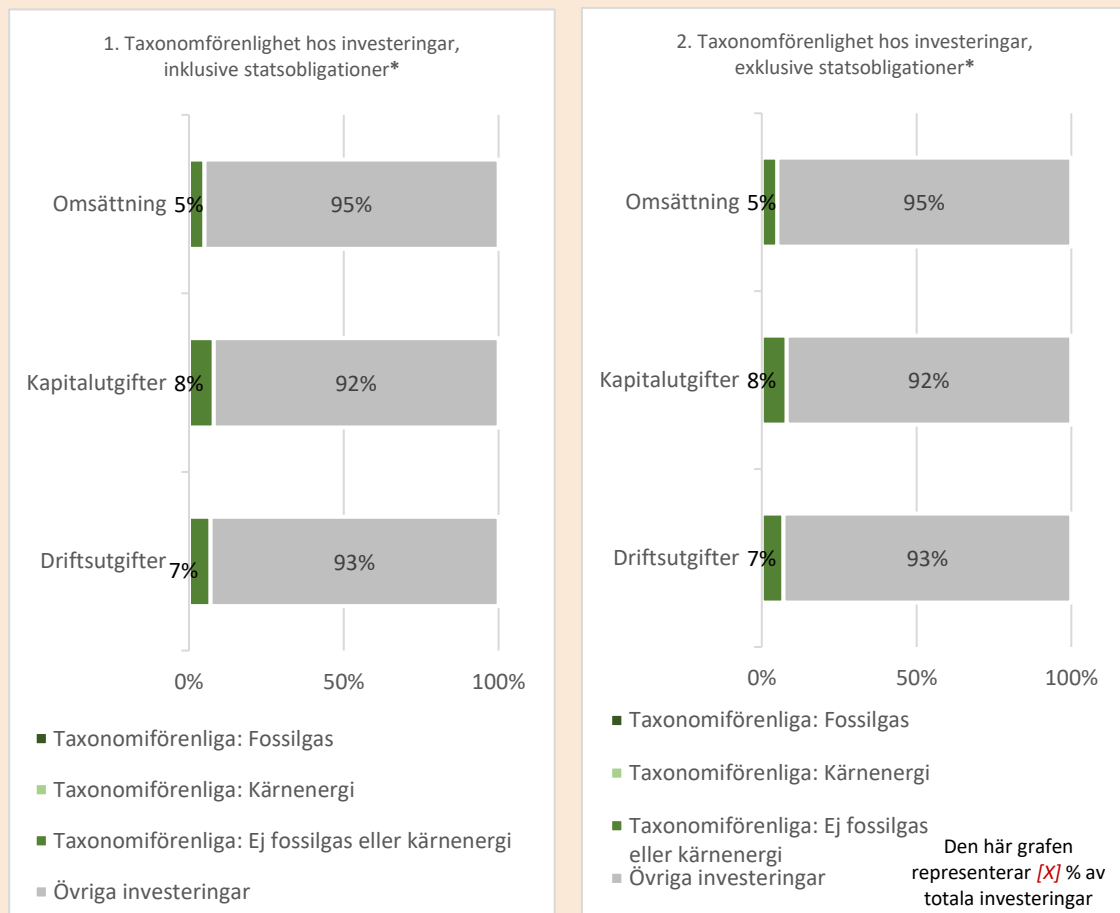
I fossilgas

I kärnenergi

Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 2 procent av Fondens värde (indirekt genom Fondens

placering i mottagarfonden) placeringar i omställningsverksamheter och 14 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp Mottagarfonden och Amundi för att säkerställa uppfyllnad av Fondens hållbarhetskriterier.

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

**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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza Fastighet by Norhammar

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0017084296

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%**

Den främjade **miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**





## I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt? *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

*[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Fastighet by Norhammar ("Fonden") är en aktivt förvaltd aktiefond med inriktning mot fastighets-, bygg- samt fastighetsutvecklingsbolag i Norden med tyngdpunkt på svenska bolag. Förvaltningen av Fonden är utlagd till NRP Anaxo Management AS ("NRP").

Genom de hållbarhetskriterier som Avanza Fonder AB ("Fondbolaget") har fastställt för Fonden har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper liksom beaktat hållbarhetsrisker under perioden.

Fonden har under perioden valt in sådana företag som bedöms främja hållbara egenskaper, exempelvis genom tillhandahållande av hållbara lokaler eller företag som bedöms genomgå övergripande hållbarhetsförbättringar.

Under perioden har Fonden valt bort placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter som vapen, krigsmateriel, alkohol, tobak, spel (gambling), pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Fondbolaget har för Fondens räkning bedrivit ett påverkansarbete under perioden i syfte att påverka utvalda bolag i en mer hållbar riktning.

### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

#### Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från vapen och krigsmateriel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från alkohol, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

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

#### Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från spel (gambling)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från spel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från pornografi, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

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

— — *Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

— — *Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

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

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.*



**Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Fonden har under perioden undvikit exponering mot verksamheter såsom bland annat, vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, spel, pornografi, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom Fondens exkluderingar av företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av

exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser.

Därutöver har Fondbolaget bedrivit ett påverkansarbete för Fondens räkning. I detta påverkansarbete bedöms Fondbolaget ha bidragit till att begränsa påverkan på ytterligare PAI-indikatorer, såsom exempelvis indikatorer rörande sociala förhållanden och personalfrågor.

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.

**Tillgångsalloker**  
**ing** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.



### Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

| Största investeringarna                         | Sektor      | % tillgångar | Land    |
|---|-------------|--------------|---------|
| Castellum<br>(SE0000379190)                     | Fastigheter | 9,22%        | Sverige |
| Sagax B<br>(SE0005127818)                       | Fastigheter | 8,91%        | Sverige |
| Fast. Balder B<br>(SE0017832488)                | Fastigheter | 7,53%        | Sverige |
| Catena<br>(SE0001664707)                        | Fastigheter | 6,27%        | Sverige |
| Nyfosa<br>(SE0011426428)                        | Fastigheter | 6,19%        | Sverige |
| Wihlborgs Fastigheter<br>(SE0018012635)         | Fastigheter | 5,30%        | Sverige |
| Platzer Fastigheter Holding B<br>(SE0004977692) | Fastigheter | 4,55%        | Sverige |
| Diös Fastigheter<br>(SE0001634262)              | Fastigheter | 4,51%        | Sverige |

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

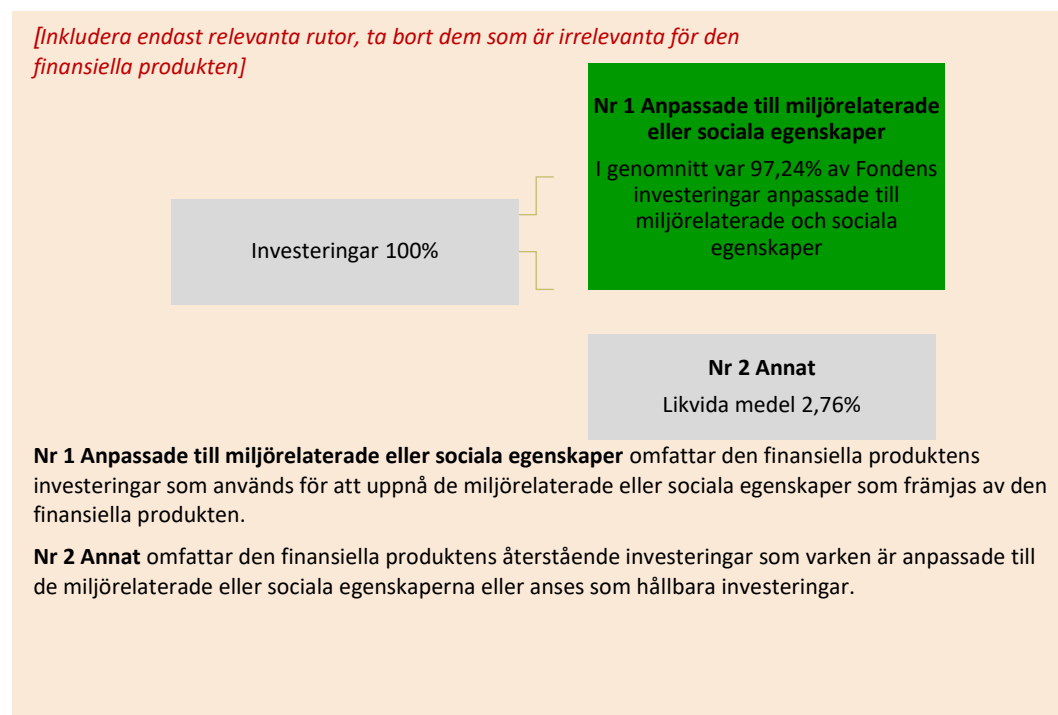


### Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har under perioden inte haft som målsättning att genomföra hållbara investeringar.

● **Vad var tillgångsallokeringen?**

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året.



● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** *Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.*

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Fastigheter                   | 98,0%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 2,0%         |
| Material                      | 0,0%         |
| Finans                        | 0,0%         |
| Dagligvaror                   | 0,0%         |
| Hälsovård                     | 0,0%         |
| Kraftförsörjning              | 0,0%         |
| Telekommunikation             | 0,0%         |
| Energi                        | 0,0%         |
| Industri                      | 0,0%         |
| Teknik                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

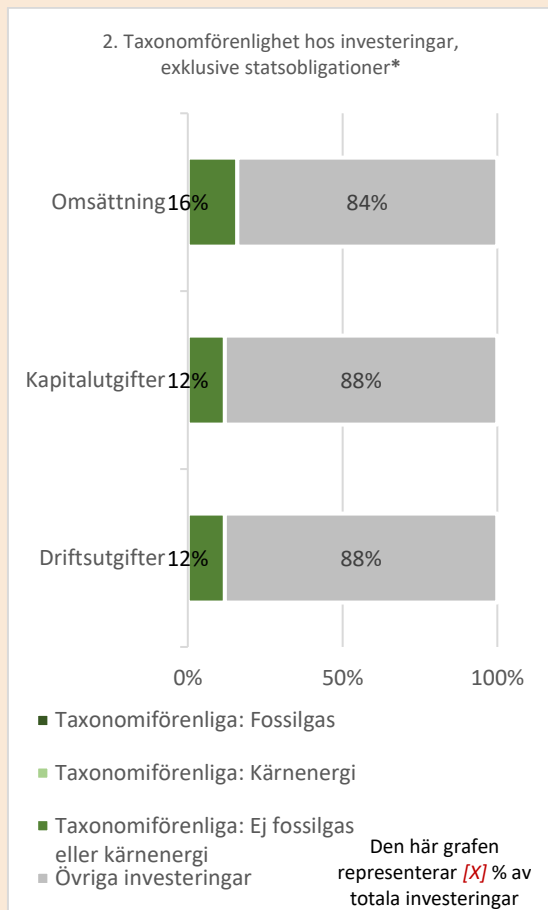
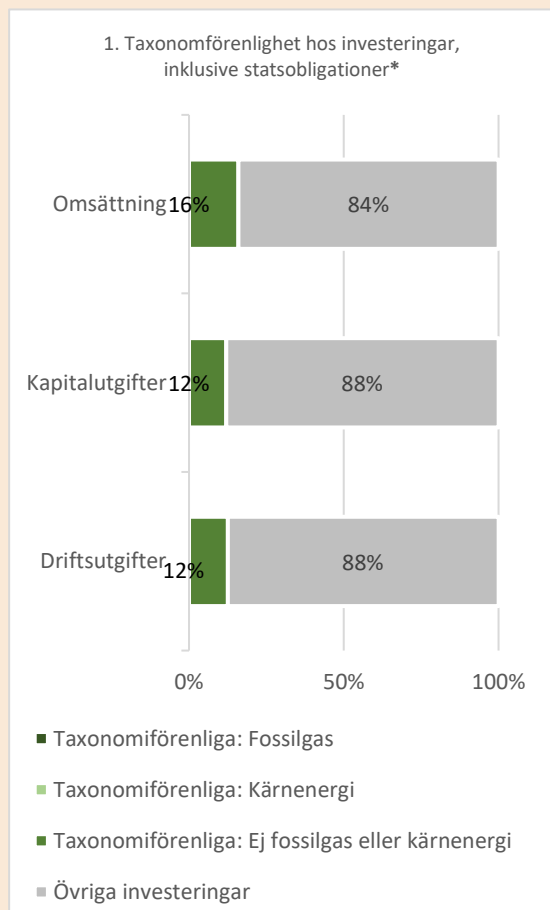
Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]

[Inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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.



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per den 31 december 2023 emellertid 0 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 0 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.





### Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?

*[räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]*

Fonden har under perioden placerat dess medel i enlighet med de hållbarhetskriterier som fastställts för Fondens främjande av miljörelaterade och sociala egenskaper. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp Fondens investeringar för att säkerställa uppfyllnad av Fondens hållbarhetskriterier.

Därutöver har ett påverkansarbete bedrivits under perioden i syfte att påverka utvalda bolag i en mer hållbar riktning.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

## Avanza Global

### Transparens i fråga om integrering av hållbarhetsrisker, om negativa konsekvenser för hållbar utveckling, om främjandet av miljörelaterade eller sociala egenskaper, och om hållbar investering

- Fonden har hållbara investeringar som mål
- Fonden främjar bland annat miljörelaterade eller sociala egenskaper
- Hållbarhetsrisker integreras i investeringsbeslut, utan att fonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper eller har hållbar investering som mål
- Hållbarhetsrisker är inte relevanta (förklaring nedan)
- Huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktas
- Huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer är inte relevanta (motivering nedan)

#### Fondbolagets kommentar:

Avanza Global är en matarfond som syftar till att vara fullinvesterad i mottagarfonden Amundi Index MSCI World ("Mottagarfonden"). Fonden integrerar inte hållbarhetsrisker och beaktar inte heller investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer då Fondens målsättning är att vara fullinvesterad i Mottagarfonden som i sin tur har som målsättning att följa utvecklingen för dess jämförelseindex som inte integrerar hållbarhetsrisker eller bedöms beakta negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer i en vidare bemärkelse. Detta innebär att hållbarhetsrisker kan ha en betydande negativ inverkan på avkastningen för fonden.

### Information om EU:s taxonomi för miljömässigt hållbara verksamheter

EU-taxonomi är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Denna fonds underliggande investeringar beaktar inte EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

### Metoder som används för att integrera hållbarhetsrisker, främja miljörelaterade eller sociala egenskaper eller för att uppnå ett hållbarhetsrelaterat mål:

#### Fonden väljer bort

Mottagarfonden 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

Klusterbomber, personminor

### Fondbolagets kommentar:

Kemiska och biologiska vapen

### Fondbolagets kommentar:

## Internationella normer

Internationella normer avser internationella konventioner, lagar och överenskommelser såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag som rör frågor om miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden investerar inte i bolag som kränker internationella normer. Bedömningen görs antingen av fondbolaget självt eller av en underleverantör.

### Fondbolagets kommentar:

Fonden investerar inte i bolag som inte vidtar åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta med problemen under en tid som fondbolaget bedömer som rimlig i det enskilda fallet.

Detta alternativ avser fonder som tar fram en handlingsplan för ifrågasatta bolag, som exkluderas om angivna villkor inte uppfylls under utsatt tidsperiod.

### Fondbolagets kommentar:

## Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Detta alternativ avser fonder som gör en landspecifik hållbarhetsanalys som resulterar i att bolag involverade i vissa länder exkluderas eller att räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater exkluderas.

### Fondbolagets kommentar:

## Övrigt

Övrigt

### Fondbolagets kommentar:

**Fondbolaget påverkar**

Fondbolaget använder sitt inflytande för att påverka bolag i hållbarhetsrelaterade frågor. Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar: Avser Mottagarfondbolaget Amundi Luxembourg S.A ("Amundi").

Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare

Fondbolagets kommentar: Avser Mottagarfondbolaget Amundi.

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar: Avser Mottagarfondbolaget Amundi.

## Uppföljning av hållbarhetsarbetet

### Information om EU:s taxonomi för miljömässigt hållbara verksamheter

EU-taxonomi är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Denna fonds underliggande investeringar beaktar inte EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

### Metoder som använts för att integrera hållbarhetsrisker, främja miljörelaterade eller sociala egenskaper eller för att uppnå ett hållbarhetsrelaterat mål:

#### Fonden har valt in

Avanza Global är en matarfond som investerar i mottagarfonden Amundi Index MSCI World. Mottagarfonden har som mål att följa utvecklingen för sitt jämförelseindex och väljer därför inte aktivt in bolag.

#### Fonden har valt bort

Mottagarfonden exkluderar kontroversiella vapen, såsom klusterbomber, personminor, kemiska och biologiska vapen. Under året har Fondbolaget haft löpande avstämningar med Amundi. Av både samtal och från officiell information har vi säkerställt att fonden tillämpat exkluderingskriterierna.

#### Fonden har påverkat

Matarfonden Avanza Global syftar till att vara fullinvesterad i mottagarfonden Amundi Index MSCI World. Mottagarfonden förvaltas av Amundi Luxembourg S.A ("Amundi"). Amundi har antagit principer för aktieägarengagemang som omfattar mottagarfonden och en årlig redogörelse publiceras på [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

## Övergripande kommentar om hållbarhetsarbetet

Avanza Fonder har under 2023 fortsatt arbetet med att utveckla sin hållbarhetsstrategi. Avanza Fonder är sedan februari 2018 medlemmar i UNPRI, Principles for Responsible Investment och har under året genomfört en rapportering i enlighet med PRI:s principer och riktlinjer.

Under det gångna året har fortsatt stort fokus lagts på EU-regelverk inom hållbarhet såsom Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen") som började tillämpas den 10 mars 2021 och där nivå 2-regler började tillämpas den 1 januari 2023.

Under året har Avanza Fonder lanserat totalt fem nya fonder. Tre av dessa fonder utgör fonder som främjar miljörelaterade och sociala egenskaper i enlighet med artikel 8 i Disclosureförordningen samt två av fonderna utgör fonder som har hållbara investeringar som mål i enlighet med artikel 9 i Disclosureförordningen.

Avanza Fonder ser löpande över och arbetar med att utveckla sin hållbarhetsstrategi för samtliga fonder under dess förvaltning.

## BILAGA V

### Mall som avser regelbundna upplysningar för de finansiella produkter som avses i artikel 9.1–9.4a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn: Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult

Identifieringskod för juridiska personer: SE0019912502

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

## Mål för hållbar investering

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger minimiåtagandet för hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål: 96,89%**

Den **främjade miljörelaterade eller sociala egenskaper och** även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade eller sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning uppnåddes denna finansiella produkts mål för hållbar investering?** *[räkna upp målen för hållbar investering för denna finansiella produkt, och beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852, ange när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i förordning (EU) 2020/852 som den finansiella produktens underliggande investering bidrog till. För de finansiella produkter som avses i artikel 9.3 i förordning (EU) 2019/2088, ange på vilket sätt målet med minskade koldioxidutsläpp var anpassade till Parisavtalet]*

Avanza Healthcare by Samuelsson & Hult ("Fonden") är en aktivt förvaltd aktiefond som investerar i bolag verksamma inom hälsovårdssektorn samt relaterade branscher vars verksamheter bidrar till FN:s sociala mål för hållbar utveckling nummer 3, god hälsa och

välbefinnande. Fonden har som målsättning att minst 90% av fonden ska bestå av hållbara investeringar.

**Hållbarhetsindikatorerna** mäter hur hållbarhetsmålen för denna finansiella produkt uppnås.

Fonden förvaltas av HealthInvest Partners AB ("HealthInvest") på uppdrag av Avanza Fonder AB ("Fondbolaget"). Mer information om HealthInvests hållbarhetsarbete finns att tillgå på [www.healthinvest.se](http://www.healthinvest.se). Inget specifikt index har valts som referensvärde för Fonden för att uppfylla målet för hållbar investering.

Fonden har perioden endast investerat i bolag som enligt HealthInvests bedömning är hållbara och bidrar till hållbarhetsmålet god hälsa och välbefinnande. Därmed uppnådde fonden sitt mål för hållbara investeringar.

### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Fonden startade den 26 maj 2023. Under perioden 26 maj till och med den 31 december utgjorde i genomsnitt 96,89% av Fonden hållbara investeringar som främjar god hälsa och välbefinnande. HealthInvest bedömer huruvida ett portföljbolag är hållbart baserat på

- i vilken utsträckning portföljbolaget bidrar till FN:s globala utvecklingsmål nummer 3, god hälsa och välbefinnande,
- vilka negativa konsekvenser portföljbolaget har på hållbarhetsfaktorer, och
- i vilken utsträckning portföljbolaget uppfyller krav på god styrning och kontroll.

För vart och ett av dessa områden har HealthInvest formulerat minimikrav som måste uppfyllas för att ett portföljbolag ska anses som hållbart.

Fonden hade under perioden inga investeringar i följande produkter/tjänster (där mer än 5 % av omsättningen är hänförlig till följande angivna produkter/tjänster):

- Klusterbomber och landminor
- Kemiska och biologiska vapen
- Kärnvapen
- Vapen eller ammunition
- Alkohol
- Tobak
- Spel
- Pornografi
- Fossila bränslen (olja, gas, kol)

Fondens hade inga investeringar i företag med säte i länder som rankas i den sämre halvan av Transparency Internationals korruptionsindex. Fonden hade inga investeringar i portföljbolag med bristande efterlevnad av FN:s globala överenskommelse och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. Se närmare redogörelse avseende Cencora (tidigare Amerisourcebergen Corp) och UnitedHealth Group Inc under rubrik *Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*.

### ● **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 26 maj 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.

### ● **Hur orsakade de hållbara investeringarna inte betydande skada för något mål för hållbar investering?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar 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.

— — Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?

Genom HealthInvests interna bedömningsverktyg har negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats. Varje portföljbolags negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer jämförs och betygsätts i förhållande till genomsnittet för de 50 största bolagen i MSCI World Health Care Index. Samtliga portföljbolag i fonden klarade de minimikrav som uppställts. Fonden har inte investerat i portföljbolag som är verksamma inom sektorn för fossila bränslen eller portföljbolag med exponering mot kontroversiella vapen.

— — Stämde de hållbara investeringarna överens med OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:

Ja, alla portföljbolag har granskas för brott mot OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter. Inga brott mot dessa riktlinjer och principer har uppdagats. Se närmare redogörelse avseende Cencora (tidigare Amerisourcebergen Corp) och UnitedHealth Group Inc under rubrik *Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*.



**Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden strävar efter att begränsa de negativa konsekvenserna för hållbarhetsfaktorer som portföljbolagens verksamhet orsakar. HealthInvest sätter interna gränsvärden för portföljbolagens negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer. Genomsnittet av de 50 största bolagen i MSCI World Health Care Index används som ett referensvärde av förvaltarna vid utvärderingen i fondens investeringsbeslutsprocess och varje portföljbolag ges ett internt betyg.

| Indikator på negativa konsekvenser för hållbar utveckling          | Konsekvenser 2023                      | Kommentar        |
|--|--|------------------|
| KLIMATRELATERADE INDIKATORER OCH ANDRA MILJÖRELATERADE INDIKATORER |  |                  |
| Scope 1-växthusgasutsläpp  | 14,38 ton CO2e                         | Täckning: 96,36% |
| Scope 2-växthusgasutsläpp  | 13,46 ton CO2e                         | Täckning: 96,36% |
| Scope 3-växthusgasutsläpp  | 338,77 ton CO2e                        | Täckning: 96,36% |
| Sammanlagda utsläpp av växthusgaser                                | 371,09 ton CO2e                        | Täckning: 96,36% |
| Koldioxidavtryck   | 27,74 ton CO2e/miljon investerade euro | Täckning: 96,36% |
| Investeringsobjektets växthusgasintensitet                         | 119,03 ton CO2e/miljon euro i intäkter | Täckning: 96,36% |



|  |   |                  |
|--|---|------------------|
| Andel av investeringar i företag som är verksamma inom sektorn för fossila bränslen  | 0,00%                                   | Täckning: 96,70% |
| Investeringsobjektets andel av icke-förnybar energiförbrukning och icke-förnybar energiproduktion från icke-förnybara energikällor jämfört med förnybara energikällor, uttryckt i procent av totala energikällor   | Förbrukning: 75,87%<br>Produktion: -    | Täckning: 78,89% |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor C: 0,05 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 95,99% |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt med platser/projekt belägna i eller i närheten av områden med känslig biologisk mångfald där investeringsobjektets verksamhet påverkar dessa områden negativt  | 0%                                      | Täckning: 98,49% |
| Ton utsläpp till vatten som genereras av investeringsobjekt per miljon investerade euro, uttryckt som ett vägt genomsnitt  | <0,01 ton/miljon investerade euro       | Täckning: 13,03% |
| Ton farligt avfall och radioaktivt avfall som genereras av investeringsobjekt per miljon investerade euro, uttryckt som ett vägt genomsnitt  | 0,09 ton/miljon investerade euro        | Täckning: 96,36% |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt som har varit inblandade i brott mot FN:s globala överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag  | 11,05%                                  | Täckning: 98,49% |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt utan strategier för att övervaka efterlevnaden av FN:s globala överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag eller mekanismer för klagomålshantering av brott mot FN:s globala överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag | 0%                                      | Täckning: 96,24% |
| Genomsnittlig ojusterad löneklyfta mellan könen hos investeringsobjekt   | 5,76%                                   | Täckning: 41,40% |
| Andel kvinnor i styrelsen  | 31,39%                                  | Täckning: 97,52% |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt som är involverade i tillverkning eller försäljning av kontroversiella vapen   | 0%                                      | Täckning: 96,70% |
| Vägd genomsnittlig andel vatten som återvinns och återanvänds av investeringsobjekt  | 0,24%                                   | Täckning: 3,82%  |

|  |       |                  |
|--|-------|------------------|
| Andel av investeringar i investeringsobjekt utan policy för vattenförvaltning  | 4,70% | Täckning: 99,29% |
| Andel investeringar i investeringsobjekt utan leverantörens uppförandekodex (mot osäkra arbetsförhållanden, osäkert arbete, barnarbete och tvångsarbete) | 0,38% | Täckning: 96,24% |
| Andel investeringar i enheter utan policy för bekämpning av korruption och mutor i enlighet med FN:s konvention mot korruption                           | 1,13% | Täckning: 98,77% |

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt PAI-verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.

Notera att den data som Clarity tillhandahåller kan komma att skilja sig åt från den data som Healthinvests investeringsbeslutsprocess och uppföljning för Fonden grundar sig på. Detta beror på att interna bedömningsverktyg liksom bedömningsverktyg som tillhandahålls av dataleverantörer i flertalet fall grundar sig på olika metoder för att beräkna datapunkterna. Därutöver kan det finnas skillnader avseende vilka tidsperioder bedömningsverktygen grundar sig på.

I tabellen ovan, som alltså grundar sig på data från Clarity, anges ett datavärde på 11,05 % avseende indikatorn *Andel av investeringar i investeringsobjekt som har varit inblandade i brott mot FN:s globala överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag*. Detta värde är hänförligt till händelser i Cencora (tidigare Amerisourcebergen Corp) respektive UnitedHealth Group Inc som utgör två innehav i Fonden. Cencora är en läkemedelsgrossist och nådde senast 2022 en förlikning gällande ansvar i opioidepidemin i USA. UnitedHealth Group Inc är ett hälso- och sjukvårdsföretag som under 2022 hade en incident som innebär att anställdas personuppgifter läckte. Enligt Claritys metodik flaggas händelserna som ett brott mot nämnda indikator. Fondbolaget har tillsammans med Healthinvest analyserat händelserna närmare och gör bedömningen att händelserna i sig är allvarliga, men att det sammantaget, bl.a. med beaktande av de åtgärder som vidtagits av bolagen, inte utgör händelser som innebär en pågående bristande efterlevnad av FN:s globala överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag. Motsvarande bedömning görs av andra dataleverantörer såsom exempelvis Datia och Sustainalytics där utfallet avseende motsvarande indikator för Fonden är 0 %.



### Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

| Största investeringarna              | Sektor    | % tillgångar | Land |
|--------------------------------------|-----------|--------------|------|
| UnitedHealth Group<br>(US91324P1021) | Hälsovård | 7,62%        | USA  |
| Eli Lilly<br>(US5324571083)          | Hälsovård | 6,98%        | USA  |

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230526-20231231. Fonden startade 2023-05-26 och siffran utgör ett genomsnitt av 3 kvartalsvisa mätperioder.

|  |           |       |                |
|--|-----------|-------|----------------|
| Merck & Co<br>(US58933Y1055)                   | Hälsovård | 6,02% | USA            |
| AstraZeneca<br>(GB0009895292)                  | Hälsovård | 4,93% | Storbritannien |
| Thermo Fisher Scientific<br>(US8835561023)     | Hälsovård | 4,89% | USA            |
| Novo Nordisk B<br>(DK0062498333)               | Hälsovård | 4,08% | Danmark        |
| Boston Scientific<br>(US1011371077)            | Hälsovård | 3,12% | USA            |
| Stryker<br>(US8636671013)                      | Hälsovård | 3,04% | USA            |
| Vertex Pharmaceuticals<br>(US92532F1003)       | Hälsovård | 2,93% | USA            |
| AbbVie<br>(US00287Y1091)                       | Hälsovård | 2,81% | USA            |
| Regeneron<br>Pharmaceuticals<br>(US75886F1075) | Hälsovård | 2,76% | USA            |
| Cencora<br>(US03073E1055)                      | Hälsovård | 2,74% | USA            |



### Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden bestod till 96,89% av hållbara investeringar med målet god hälsa och välbefinnande.

#### ● Vad var tillgångsallokeringen?

96,89% av Fondens investeringar utgjorde kategori Nr 1 Hållbara. Kategori Nr 2 Inte hållbara utgjorde 3,11% likvida medel (kassa). Fonden startade den 26 maj. Siffrorna utgör ett genomsnitt av tre kvartalsvisa mätperioder under året.

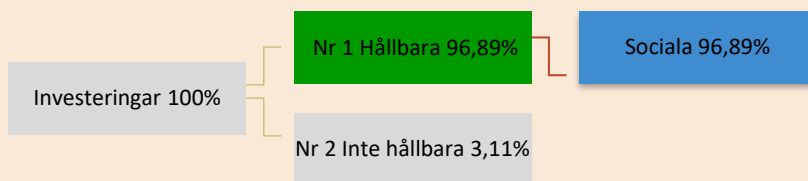
*[inkludera anmärkning endast för finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852*

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanterings regler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

*[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]*



**Nr 1 Hållbara** omfattar hållbara investeringar med miljömål eller sociala mål.

**Nr 2 Inte hållbara** omfattar investeringar som inte anses vara hållbara investeringar.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?**

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Hälsovård                     | 100,0%       |
| Material                      | 0,0%         |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 0,0%         |
| Finans                        | 0,0%         |
| Fastigheter                   | 0,0%         |
| Dagligvaror                   | 0,0%         |
| Kraftförsörjning              | 0,0%         |
| Telekommunikation             | 0,0%         |
| Energi                        | 0,0%         |
| Industri                      | 0,0%         |
| Teknik                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel*

*5 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 59 i denna förordning]*

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål.

● **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*



I fossilgas



I kärnenergi

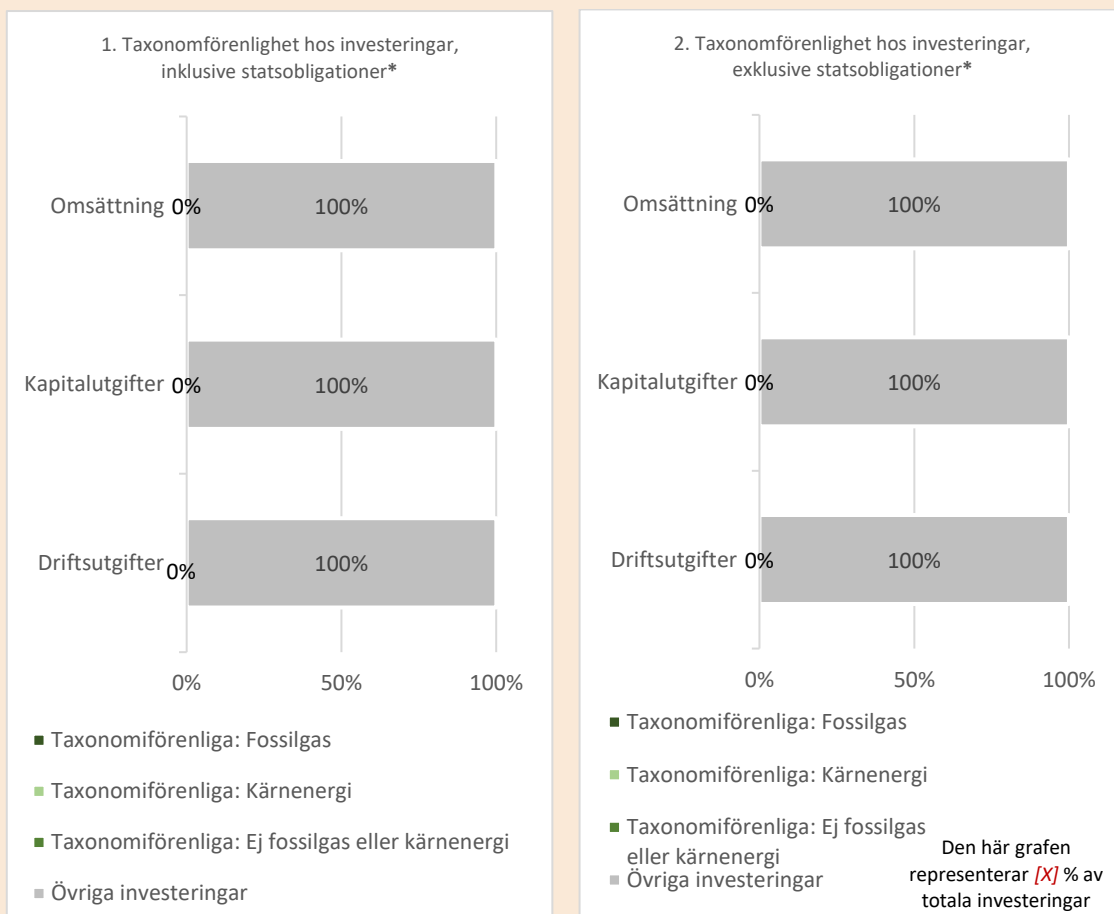
Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]

[Inkludera anmärkning endast för finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket 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.




\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [Inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt något åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Fonden hade per den 31 december 2023 heller inte några placeringar i vare sig omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[inkludera anmärkning för finansiella produkter som avses i artikel 5 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 enligt EU-taxonomin.

● **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 26 maj 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.

**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenliga med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]



Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål.

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehåller hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden bestod till 96,89% av hållbara investeringar med det sociala målet god hälsa och välbefinnande.



**Vilka investeringar inkluderades i kategorin "Inte hållbara", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

I kategorin "Inte hållbara" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått. Fondens likvida medel utgjorde 3,11% i snitt under 2023.

Inga miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder tillämpas på fondens likvida medel.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppnå målet för hållbar investering under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppnå målet för hållbar investering för den finansiella produkten, däribland aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang med avseende på målet för hållbar investering]

[räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppnå målet för hållbar investering för den finansiella produkten, däribland aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang med avseende på målet för hållbar investering]

Inför varje investering i ett nytt portföljbolag har en noggrann bedömning gjorts av huruvida portföljbolaget kan anses vara hållbart utifrån de kriterier som ställts upp för Fonden. Fonden har också screenats för att säkerställa att inga investeringar görs i portföljbolag med verksamhet kopplat till sådana produkter/tjänster som listas ovan under rubriken "Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?". Fondens innehav har också screenats för att säkerställa att fonden inte investerar i portföljbolag med bristande efterlevnad av FN:s globala överenskommelse och OECD:s

riktlinjer för multinationella företag eller med säte i länder som rankas i den sämre halvan av Transparency Internationals korruptionsindex. Resultatet dokumenteras och följs upp regelbundet.

HealthInvest har under 2023 genomfört dialoger med portföljbolag i syfte att uppmuntra portföljbolag till förbättringar på hållbarhetsområdet eller påtala brister.



*valda indexet]*

**Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet för hållbar investering?** *[inkludera avsnitt endast för de finansiella produkter som avses i artikel 9.1 i förordning (EU) 2019/2088 och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det*

Inget index har valts som referensvärde för att uppfylla Fondens mål för hållbar investering.

*[inkludera  
anmärkning för  
finansiella  
produkter som  
avses i artikel 9.1  
i förordning (EU)  
2019/2088]*

#### **Referensvärden**

är index för att mäta om den finansiella produkten uppnår målet för hållbar investering.



## BILAGA V

### Mall som avser regelbundna upplysningar för de finansiella produkter som avses i artikel 9.1–9.4a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852

Produktnamn: Avanza Impact by Circulus

Identifieringskod för juridiska personer: SE0019354226

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

## Mål för hållbar investering

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger minimiåtagandet för hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorde **hållbara investeringar med ett miljömål:** 62,31%

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

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

Den gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** 35,61%

Den **främjade miljörelaterade eller sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade eller sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



### I vilken utsträckning uppnåddes denna finansiella produkts mål för hållbar investering?

*[räkna upp målen för hållbar investering för denna finansiella produkt, och beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852, ange när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i förordning (EU) 2020/852 som den finansiella produktens underliggande investering bidrog till. För de finansiella produkter som avses i artikel 9.3 i förordning (EU) 2019/2088, ange på vilket sätt målet med minskade koldioxidutsläpp var anpassade till Parisavtalet]*

Avanza Impact by Circulus ("Fonden") är en aktivt förvaltd aktiefond som investerar i mikro- och småbolag med ekonomisk verksamhet som bidrar till att uppnå ett eller flera av målen för hållbar utveckling i Agenda 2030. Detta omfattar ekonomisk verksamhet inom t.ex. förnybar energi, energieffektivitet, hållbar livsmedelsproduktion, utsläppsnåla transporter, bevarande av

biologisk mångfald, anpassning till klimatförändringar, vattenrening, finansiell inkludering och ökad tillgång till hälso- och sjukvård.

Fonden förvaltas av Coeli Asset Management AB ("Coeli") på uppdrag av Avanza Fonder AB ("Fondbolaget"). Mer information om Coelis hållbarhetsarbete finns att tillgå på [www.coeli.se](http://www.coeli.se). Inget specifikt index har valts som referensvärde för Fonden för att uppfylla målet för hållbar investering.

Fonden har under perioden endast investerat i bolag som enligt Coelis bedömning utgör hållbara investeringar och vars verksamheter bidrar till lösningar på FN:s Globala Mål (enligt definitionen i Agenda 2030). Detta inkluderade ekonomiska aktiviteter inom exempelvis förnybar energi, energieffektivitet, hållbar livsmedelsproduktion, lågutsläppstransport, bevarande av biologisk mångfald, anpassning till klimatförändringar, vattenrening, finansiell inkludering samt ökad tillgång till sjukvård.

Nedan listas de miljö- och sociala mål som fonden hade under referensperioden:

### **Miljömål**

Fonden investerade i bolag vars verksamheter bidrar till ett eller flera av följande miljömål för hållbar utveckling i Agenda 2030:

Mål 2. Avskaffa hunger, uppnå tryggad livsmedelsförsörjning och förbättrad nutrition samt främja ett hållbart jordbruk.

Mål 6. Säkerställa tillgången till och en hållbar förvaltning av vatten och sanitet för alla.

Mål 7. Säkerställa tillgång till ekonomiskt överkomlig, tillförlitlig, hållbar och modern energi för alla.

Mål 9. Bygga motståndskraftig infrastruktur, verka för en inkluderande och hållbar industrialisering samt främja innovation.

Mål 12. Säkerställa hållbara konsumtions- och produktionsmönster.

Mål 13. Vidta omedelbara åtgärder för att bekämpa klimatförändringarna och deras konsekvenser.

Mål 14. Bevara och nyttja haven och de marina resurserna på ett hållbart sätt för en hållbar utveckling

Mål 15. Skydda, återställa och främja ett hållbart nyttjande av landbaserade ekosystem, hållbart bruka skogar, bekämpa ökenspridning, hejda och vrida tillbaka markförstöringen samt hejda förlusten av biologisk mångfald.

Ovanstående inkluderar att göra hållbara investeringar som syftar till att till viss del bidra till en eller flera av de sex miljörelaterade målen i förordning (EU) 2020/852 från Europaparlamentet och rådet av den 18 juni 2020 om upprättande av en ram för att underlätta hållbara investeringar (Taxonomiförordningen):

- (1) begränsning av klimatförändringar
- (2) anpassning till klimatförändringar
- (3) hållbar användning och skydd av vatten och marina resurser
- (4) övergång till en cirkulär ekonomi
- (5) förebyggande och kontroll av föroreningar
- (6) skydd och återställande av biologisk mångfald och ekosystem.

### **Sociala mål**

Fonden investerade i bolag vars verksamheter bidrar till ett eller flera av följande sociala mål för hållbar utveckling i Agenda 2030:

Mål 3. Säkerställa hälsosamma liv och främja välbefinnande för alla i alla åldrar.

Mål 4. Säkerställa en inkluderande och likvärdig utbildning av god kvalitet och främja livslångt lärande för alla.

Mål 5. Uppnå jämställdhet och alla kvinnors och flickors egenmakt.

Mål 8. Verka för varaktig, inkluderande och hållbar ekonomisk tillväxt, full och produktiv sysselsättning med anständiga arbetsvillkor för alla.

Mål 10. Minska ojämlikheten inom och mellan länder.

Mål 11. Göra städer och bosättningar inkluderande, säkra, motståndskraftiga och hållbara.

Mål 16. Främja fredliga och inkluderande samhällen för hållbar utveckling, tillhandahålla tillgång till rättvisa för alla samt bygga upp effektiva och inkluderande institutioner med ansvarsutkrävande på alla nivåer.

**Hållbarhetsindikatorerna** mäter hur hållbarhetsmålen för denna finansiella produkt uppnås.

### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Fonden startade den 10 mars 2023. För att bedöma hur väl Fondens mål för hållbara investeringar har uppnåtts använder Fondbolaget följande indikatorer.

- Andel av intäkter från ekonomiska verksamheter relaterade till produkter eller tjänster som bidrar till uppfyllelse av ett eller flera av de globala målen för hållbar utveckling (definierade i Agenda 2030), inklusive de sex miljömålen i Taxonomiförordningen. De ekonomiska verksamheterna räknas enbart så länge bolaget inte orsakar betydande skada samt uppvisar god styrning.

Resultatet har, genom att Fonden enbart haft exponering mot företag med intäkter som till minst 50% härstammar från ekonomiska verksamheter relaterade till produkter eller tjänster som bidrar till uppfyllelse av ett eller flera av de globala målen för hållbar utveckling (definierade i Agenda 2030), under perioden 10 mars till och med den 31 december, varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- Andel av intäkter från ekonomiska verksamheter relaterade till produktion och distribution av kontroversiella vapen, kärnvapen, vapen, alkohol, tobak, cannabis, pornografi, kommersiell spelverksamhet och fossila bränslen.

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från nämnda verksamheter, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- Andel investeringar i bolag som är involverade i tillverkning, utveckling eller försäljning av kontroversiella vapen.

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

- Brott mot FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

**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.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Fonden startade den 10 mars 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.

- **Hur orsakade de hållbara investeringarna inte betydande skada för något mål för hållbar investering?** *[inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]*

Fonden har enbart investerat i företag som uppfyller kriterierna för att inte orsaka betydande skada. Analysen av detta ryms inom den genomlysningssprocess som Coeli tillämpar inför en investering. I genomlysningssprocessen utgår Coeli från en internt utvecklad analysmodell baserad på FN Global Compact SDG Business Benchmark och de globala målen för hållbar utveckling.

- — **Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?**

Analysen av huruvida ett företag orsakar betydande skada omfattar indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer. Analysen utgår från en internt utvecklad modell som utgår från tio olika frågor som baseras på FN Global Compact SDG Business Benchmark, inklusive specifika referenser till varje indikator för negativa konsekvenser. Företag med ett betyg om 1 anses orsaka betydande skada.

Fonden har därtill tillämpat en exkluderingsstrategi där exkludering av företag bland annat grundar sig på vilka verksamheter som orsakar betydande skada på indikatorerna för negativa konsekvenser.

- — **Stämde de hållbara investeringarna överens med OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:**

Fonden har under perioden enbart investerat i bolag som lever upp till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter. Analysen av detta ryms inom den genomlysningssprocess som Coeli tillämpar inför en investering. Uppföljning sker därefter löpande för att säkerställa fortsatt efterlevnad. Analysen grundar sig på data som tillhandahålls av en utomstående leverantör.



- **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställts för Fonden. Fonden har under perioden valt bort företag med intäkter från kontroversiella vapen och företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter såsom vapen, alkohol, tobak, cannabis, kommersiell spelverksamhet, pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas) samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner. Utöver exkluderingar har påverkansdialoger och

röstning utförts med utvalda företag som Fonden placerat i. På så sätt har indikatorer för negativa konsekvenser beaktats såsom:

| Indikator på negativa konsekvenser för hållbar utveckling  | Konsekvenser 2023                       | Kommentar        |
|--|---|------------------|
| KLIMATRELATERADE INDIKATORER OCH ANDRA MILJÖRELATERADE INDIKATORER   |   |                  |
| Scope 1-växthusgasutsläpp  | 228,72 ton CO2e                         | Täckning: 92,84% |
| Scope 2-växthusgasutsläpp  | 99,78 ton CO2e                          | Täckning: 92,84% |
| Scope 3-växthusgasutsläpp  | 1277,07 ton CO2e                        | Täckning: 92,84% |
| Sammanlagda utsläpp av växthusgaser  | 1634,22 ton CO2e                        | Täckning: 92,84% |
| Koldioxidavtryck   | 197,03 ton CO2e/miljon investerade euro | Täckning: 92,84% |
| Investeringsobjektets växthusgasintensitet   | 609,65 ton CO2e/miljon euro i intäkter  | Täckning: 92,84% |
| Andel av investeringar i företag som är verksamma inom sektorn för fossila bränslen  | 2,48%                                   | Täckning: 88,71% |
| Investeringsobjektets andel av icke-förnybar energiförbrukning och icke-förnybar energiproduktion från icke-förnybara energikällor jämfört med förnybara energikällor, uttryckt i procent av totala energikällor | Förbrukning: 80,65%<br>Produktion: -    | Täckning: 19,37% |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor A: 1,99 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 97,96% |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor B: 3,40 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 100%   |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor C: 0,64 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 100%   |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor E: 0,32 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 100%   |

|  |   |                  |
|--|---|------------------|
| investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   |   |                  |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor F: 0,05 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 73,25% |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor G: 0,01 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 100%   |
| Energiförbrukning i GWh per miljon euro i intäkter från investeringsobjekt, per sektor med stor klimatpåverkan   | Sektor H: 0,19 GWh/miljon euro intäkter | Täckning: 100%   |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt med platser/projekt belägna i eller i närheten av områden med känslig biologisk mångfald där investeringsobjektens verksamhet påverkar dessa områden negativt  | 0%                                      | Täckning: 83,55% |
| Ton utsläpp till vatten som genereras av investeringsobjekt per miljon investerade euro, uttryckt som ett vägt genomsnitt  | 0,01 ton/miljon investerade euro        | Täckning: 19,87% |
| Ton farligt avfall och radioaktivt avfall som genereras av investeringsobjekt per miljon investerade euro, uttryckt som ett vägt genomsnitt  | 3,62 ton/miljon investerade euro        | Täckning: 92,84% |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt som har varit inblandade i brott mot FN:s globala överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag  | 0%                                      | Täckning: 83,55% |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt utan strategier för att övervaka efterlevnaden av FN:s globala överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag eller mekanismer för klagomålshantering av brott mot FN:s globala | 0%                                      | Täckning: 82,41% |

|  |        |                  |
|--|--------|------------------|
| överenskommelse eller OECD:s riktlinjer för multinationella företag  |        |                  |
| Genomsnittlig ojusterad löneklyfta mellan könen hos investeringsobjekt   | 14,62% | Täckning: 10,46% |
| Andel kvinnor i styrelsen  | 31,22% | Täckning: 97,52% |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt som är involverade i tillverkning eller försäljning av kontroversiella vapen                                 | 0%     | Täckning: 96,70% |
| Vägd genomsnittlig andel vatten som återvinns och återanvänds av investeringsobjekt  | 0,25%  | Täckning: 2,04%  |
| Andel av investeringar i investeringsobjekt utan policy för vattenförvaltning  | 21,74% | Täckning: 91,48% |
| Andel investeringar i investeringsobjekt utan leverantörens uppförandekodex (mot osäkra arbetsförhållanden, osäkert arbete, barnarbete och tvångsarbete) | 13,32% | Täckning: 81,67% |
| Andel investeringar i enheter utan policy för bekämpning av korruption och mutor i enlighet med FN:s konvention mot korruption                           | 5,37%  | Täckning: 91,48% |

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt PAI-verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.

Notera att den data som Clarity tillhandahåller kan komma att skilja sig åt från den data som Coelis investeringsbeslutsprocess och uppföljning för Fonden grundar sig på. Detta beror på att interna bedömningsverktyg liksom bedömningsverktyg som tillhandahålls av dataleverantörer i flertalet fall grundar sig på olika metoder för att beräkna datapunkterna. Därutöver kan det finnas skillnader avseende vilka tidsperioder bedömningsverktygen grundar sig på.

I tabellen ovan, som alltså grundar sig på data från Clarity, anges ett datavärde på 2,48 procent avseende indikatorn *Andel av investeringar i företag som är verksamma inom sektorn för fossila bränslen*. Detta värde är hänförligt till Fondens innehav i *Pure Cycle Corporation* som per den 31 december 2023 utgjorde 2,18 procent av portföljen. På grund av att Clarity saknar data för ca 11,20 procent av portföljen avseende den del som var placerad i bolag, räknas detta värde upp (2.18 procent / (99.13 procent - 11.20 procent)). Claritys metodik för denna datapunkt flaggar upp bolag som är involverade i produktion av

fossila bränslen, oavsett hur stor andel av bolagets intäkter som är hänförliga till produktion av fossila bränslen. Vad avser *Pure Cycle Corporation* så är mindre än 5 procent av bolagets intäkter hänförliga till produktion av fossila bränslen, vilket även linjerar med Fondens hållbarhetskriterier om att välja bort företag med intäkter som överstiger 5 procent från fossila bränslen.



### Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

| Största investeringarna                            | Sektor           | % tillgångar | Land           |
|--|------------------|--------------|----------------|
| Graphic Packaging Holding<br>(US3886891015)        | Sällanköpsvaror  | 4,59%        | USA            |
| Hikma Pharmaceuticals<br>(GB00B0LCW083)            | Hälsovård        | 4,45%        | Storbritannien |
| Maximus<br>(US5779331041)                          | Industri         | 3,99%        | USA            |
| ADvTECH LTV<br>(ZAE000031035)                      | Dagligvaror      | 3,51%        | Sydafrika      |
| 5N Plus<br>(CA33833X1015)                          | Material         | 3,33%        | Kanada         |
| ReposiTrak<br>(US7002153044)                       | Teknik           | 3,15%        | USA            |
| Altus Power<br>(US02217A1025)                      | Kraftförsörjning | 2,92%        | USA            |
| Global Water Resources<br>(US3794631024)           | Kraftförsörjning | 2,70%        | USA            |
| Clean Harbours<br>(US1844961078)                   | Industri         | 2,70%        | USA            |
| H2O Innovation<br>(CA4433003064)                   | Kraftförsörjning | 2,69%        | Kanada         |
| Volution Group<br>(GB00BN3ZZ526)                   | Industri         | 2,64%        | Storbritannien |
| Bright Horizons Family Solutions<br>(US1091941005) | Sällanköpsvaror  | 2,37%        | USA            |
| Bioceres Crop Solutions<br>(KYG1117K1141)          | Material         | 2,34%        | Argentina      |
| Darling Ingredients                                | Dagligvaror      | 2,31%        | USA            |

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230310-20231231. Fonden startade 2023-03-10 och siffran utgör ett genomsnitt av 4 kvartalsvisa mätperioder.



[inkludera anmärkning endast för finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852

(US2372661015)  
Gates Industrial  
(GB00BD9G2S12)

Industri

2,07%

USA

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas**



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller

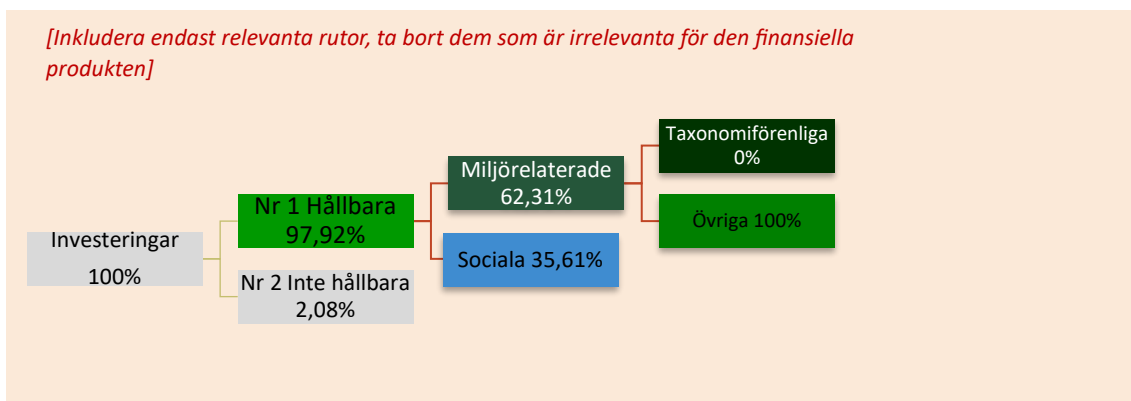
## Vad var tillgångsallokeringen?

koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller

97,92% av Fondens investeringar utgjorde kategori Nr 1 Hållbara. Kategori Nr 2 Inte hållbara utgjorde 2,08% likvida medel (kassa). Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra kvartalsvisa mätperioder under året.

**kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

## I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Industri                      | 34,4%        |
| Hälsovård                     | 12,5%        |
| Teknik                        | 12,5%        |
| Dagligvaror                   | 12,0%        |
| Kraftförsörjning              | 9,2%         |
| Material                      | 8,9%         |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 7,8%         |

*[inkludera anmärkning endast för finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket 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.

|                   |      |
|-------------------|------|
| Finans            | 2,5% |
| Fastigheter       | 0%   |
| Telekommunikation | 0%   |
| Energi            | 0%   |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.



### I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin? *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 59 i denna förordning]*

*[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 59 i denna förordning]*

För Fonden har i dagsläget ingen minimiandel fastställts för sådana hållbara investeringar med miljömål i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin. Detta ska emellertid inte förstås som att Fonden inte gör eller kommer göra sådana investeringar. I graferna nedan redogörs i hur stor utsträckning de hållbara investeringarna med ett miljömål var förenliga med EU-taxonomin.

#### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*



I fossilgas

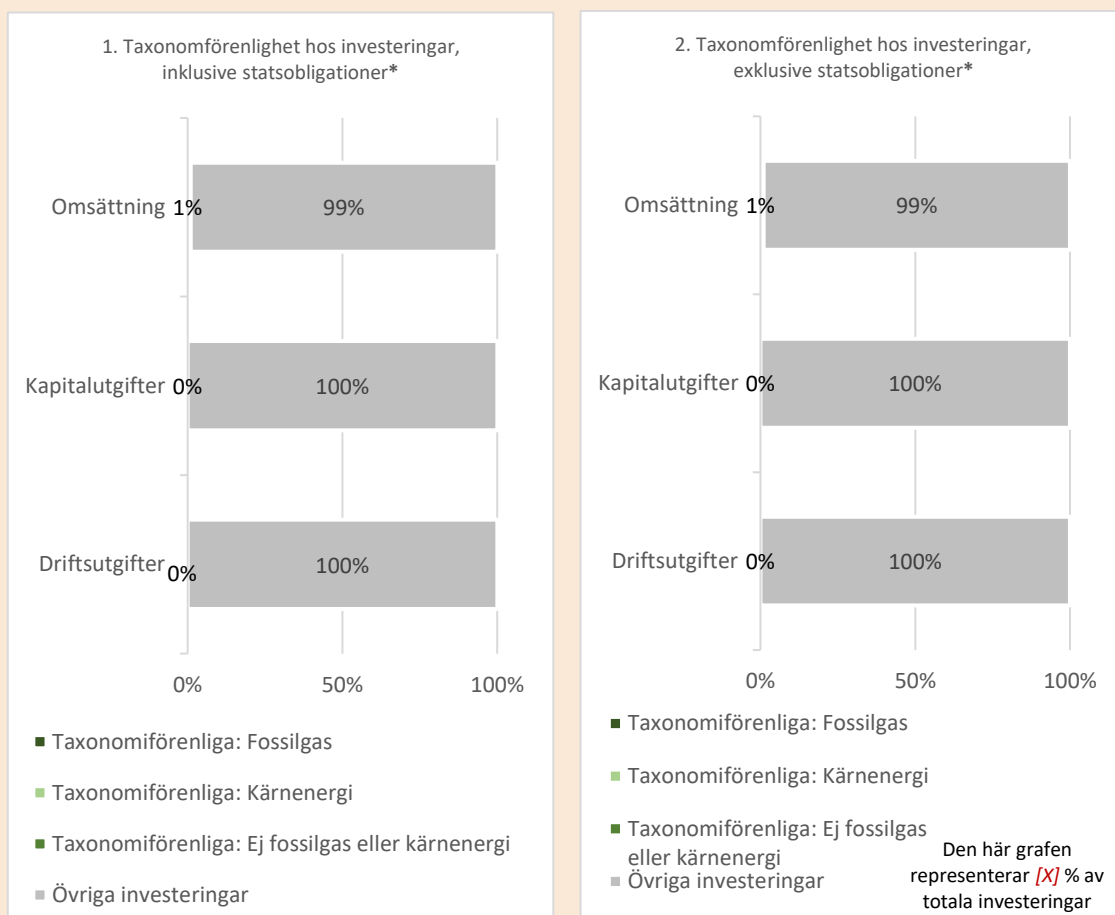


I kärnenergi

Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställnings-verksamheter och/eller möjliggörande verksamheter.

Baserat på data från Clarity så utgjorde per den 31 december 2023 emellertid 2 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 17 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

*[inkludera anmärkning för finansiella produkter som avses i artikel 5 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 enligt EU-taxonomin.

● **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** *[inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Fonden startade den 10 mars 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]*

*[inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 5 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]*

Under året utgjorde 62,31% av fondens investeringar hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenliga med EU-taxonomin.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** *[inkludera endast där den finansiella produkten innehåller hållbara investeringar med ett socialt mål]*

Under året utgjorde 35,61% av fondens investeringar socialt hållbara investeringar.



**Vilka investeringar inkluderades i kategorin "Inte hållbara", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

I "Nr 2 Inte hållbara" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.

Inga miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder tillämpas på fondens likvida medel.



### Vilka åtgärder har vidtagits för att uppnå målet för hållbar investering under referensperioden?

*[räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppnå målet för hållbar investering för den finansiella produkten, däribland aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang med avseende på målet för hållbar investering]*

Fonden investerade enbart i bolag med verksamheter som bidragit till lösningar på de globala målen för hållbar utveckling (enligt definitionen i Agenda 2030). Coeli har under perioden inför varje ny investering för Fondens räkning analyserat investeringens potentiella bidrag till ett eller flera av delmålen och indikatorerna i Agenda 2030. Vidare arbetade Coeli aktivt för Fondens räkning med att stärka befintliga investeringars bidrag till de globala målen. Detta exempelvis genom att driva på för att de bolag som utgör underliggande investeringar i Fonden fastställer egna vetenskapligt förankrade klimatmål (SBT).



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet för hållbar investering?

*[inkludera avsnitt endast för de finansiella produkter som avses i artikel 9.1 i förordning (EU) 2019/2088 och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för att uppfylla Fondens mål för hållbar investering.

*[inkludera anmärkning för finansiella produkter som avses i artikel 9.1 i förordning (EU) 2019/2088]*

**Referensvärde**  
n är index för att mäta om den finansiella produkten uppnår målet för hållbar investering.

**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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza Ränta Global

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0021021417

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_%

Den främjade **miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Ränta Global ("Fonden") är en matarfond som avser att vara fullinvesterad i mottagarfonden Captor Global Fixed Income ("Mottagarfonden"). Genom att vara fullinvesterad i Mottagarfonden som är en artikel 8-fond enligt EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"), främjar Fonden miljörelaterade och sociala egenskaper.

Mottagarfonden är en global företagsobligationsfond som investerar i svenska säkerställda bostadsobligationer i kombination med kreditderivat för att upprätthålla den globala kreditexponeringen, samt räntederivat för positioner i svenska räntor med lång löptid. Fonden kan periodvis även investera i företagsobligationer eller obligationer utgivna eller garanterade av stater, kommuner och överstatliga organisationer.

Genom Fondens placering i Mottagarfonden, liksom de exkluderingskriterier som tillämpas för Mottagarfonden, har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Under perioden har Mottagarfonden *valt bort* placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter som vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, spelverksamhet, pornografi, fossila bränslen (kol, olja, gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. (Företag där mottagarfondbolaget inte ser förändringsvilja eller bedömer att företagen inte kommer att komma till rätta med problemen under en acceptabel tidshorisont, underkänns för investering.)
- investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista

Mottagarfonden förvaltas av Captor Fund Management AB ("Captor"). För mer information om Captor och dess hållbarhetsarbete, se [www.captor.se](http://www.captor.se).

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

● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från vapen och krigsmateriel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från alkohol, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från spel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från spel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från pornografi, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Brott mot FN Global Compact

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel gröna, sociala eller hållbara obligationer

Mottagarfonden har inte fastställt någon minimiandel för hållbara investeringar, men har där så bedömts vara möjligt, baserat på de likviditets- och avkastningskrav som gäller för Mottagarfonden, valt in gröna, sociala eller hållbara obligationer. Andel gröna obligationer per den 31 december 2023 var 2,6 procent.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 7 december 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera



*för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosuresförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna bidrar till fastställs och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

**På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** *[inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosuresförordningen. Detta analyseras och redovisas av Captor. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Captors webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

**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.

*Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosuresförordningen. Detta analyseras och redovisas av Captor. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Captors webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

*Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklARATION om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara

investeringar i Disclosureförordningen. Detta analyseras och redovisas av Captor. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Captors webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*I EU-taxonomin fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonominns mål, och åtföljs av särskilda unionskriterier.*

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.*



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Det är genom Fondens placering i Mottagarfonden som hållbarhetskriterierna har implementerats. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna samt den exkluderingsstrategi som tillämpas för Mottagarfonden, undvikit exponering mot vissa verksamheter såsom vapen, alkohol, tobak, kommersiell spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288.

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

| Största investeringarna                     | Sektor | % tillgångar | Land    |
|---|--------|--------------|---------|
| Captor Global Fixed Income A (SE0020999670) | N/A    | 99,97%       | Sverige |

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20231207-20231231. Fonden startade 2023-12-07 och siffran utgör Fondens innehav i Mottagarfonden per 2023-12-31.



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

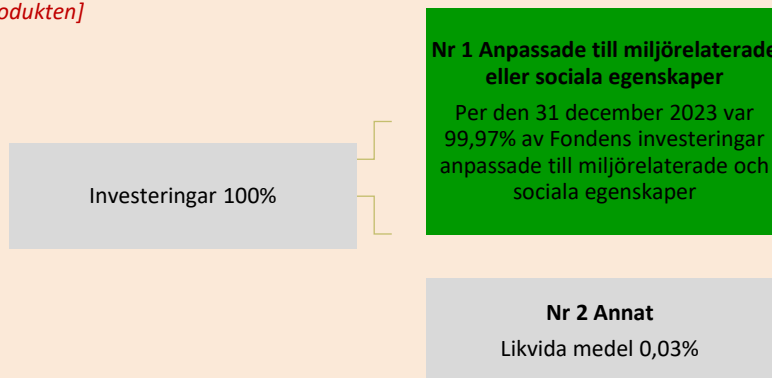
Fonden har inte haft som målsättning att genomföra hållbara investeringar under perioden.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i Mottagarfonden per den 31 december 2023. Det bör understrykas att Fondbolaget i denna bedömning utgår från Fondens placering i Mottagarfonden (som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosuresförordningen) och inte Mottagarfondens underliggande placeringar. För information om Mottagarfondens tillgångsallokering se [www.captor.se](http://www.captor.se).

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

- **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Finans                        | 54,0%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 10,5%        |
| Telekommunikation             | 7,0%         |
| Material                      | 5,5%         |
| Dagligvaror                   | 4,5%         |
| Stat                          | 4,2%         |
| Hälsovård                     | 4,0%         |
| Industri                      | 4,0%         |
| Teknik                        | 3,0%         |
| Kraftförsörjning              | 0,5%         |
| Energi                        | 0,5%         |
| Fastigheter                   | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxid snåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

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

**Omställningsverksamheter** är verksamheter som det ännu inte finns koldioxid snåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

[inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin? [inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

### **Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja [ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]

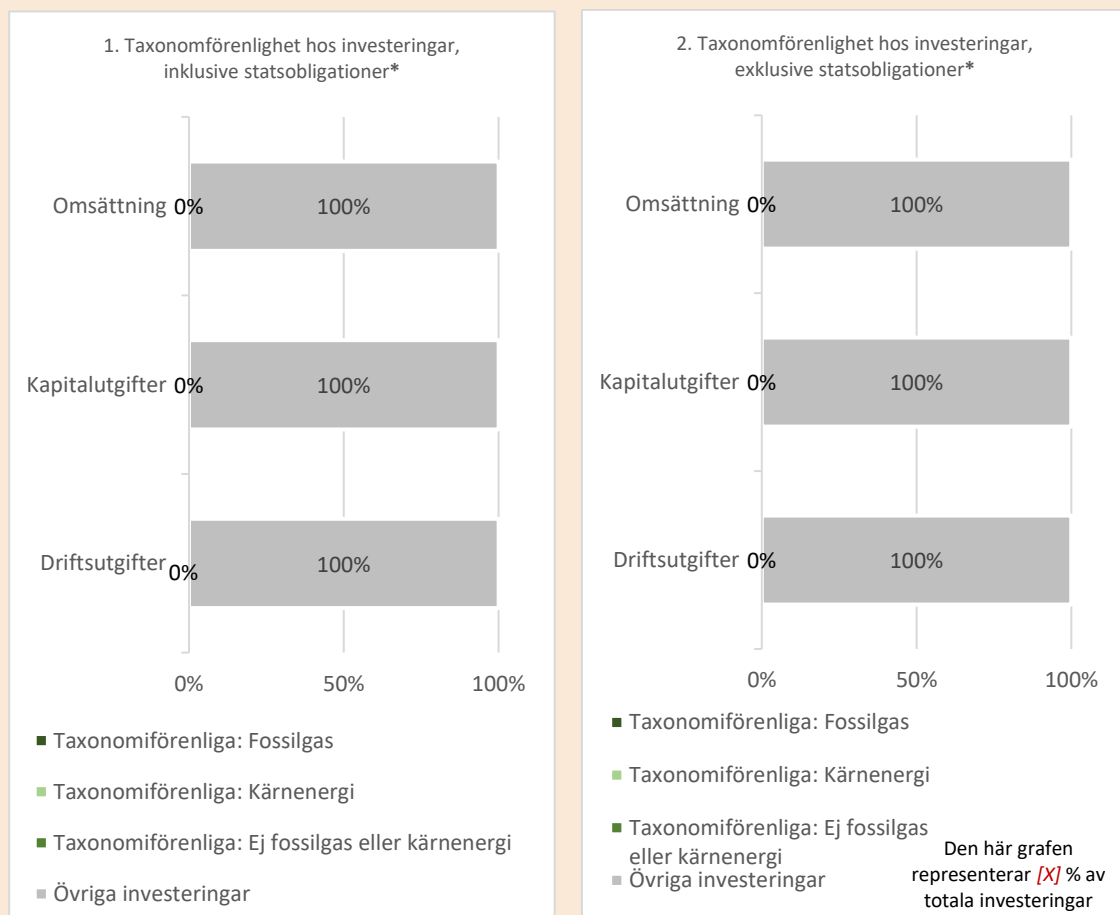
I fossilgas

I kärnenergi

Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Fonden hade per den 31 december 2023 heller inte någon exponering vare sig mot omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 7 december 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.



- **Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



- **Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



- **Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



- **Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]



Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden. Fondbolaget följer kontinuerligt upp Mottagarfonden och Captor för att säkerställa efterlevnad av Fondens hållbarhetskriterier.

*[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]*



### **Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?**

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

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

**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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza Ränta Kort

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0021021425

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_%

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



## I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt? *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

*[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Ränta Kort ("Fonden") är en matarfond som avser att vara fullinvesterad i mottagarfonden Captor Perenne Short-Term Bond ("Mottagarfonden"). Genom att vara fullinvesterad i Mottagarfonden som är en artikel 8-fond enligt EU:s förordning 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen"), främjar Fonden miljörelaterade och sociala egenskaper.

Mottagarfonden är en kort räntefond som investerar i säkerställda bostadsobligationer och obligationer utgivna eller garanterade av stater, kommuner eller överstatliga organisationer. Obligationerna ska ha hög kreditvärdighet och fondens genomsnittliga ränterisk är låg. Genom Fondens placering i Mottagarfonden, liksom de exkluderingskriterier som tillämpas för Mottagarfonden, har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Under perioden har Mottagarfonden valt bort placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter som vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, spelverksamhet, pornografi, fossila bränslen (kol, olja, gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. (Företag där mottagarfondbolaget inte ser förändringsvilja eller bedömer att företagen inte kommer att komma till rätta med problemen under en acceptabel tidshorisont, underkänns för investering.)
- investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista

Mottagarfonden förvaltas av Captor Fund Management AB ("Captor"). För mer information om Captor och dess hållbarhetsarbete, se [www.captor.se](http://www.captor.se).

### ● Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?

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

#### Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från vapen och krigsmateriel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från alkohol, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från spel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från pornografi, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel gröna, sociala eller hållbara obligationer

Mottagarfonden har inte fastställt någon minimiandel för hållbara investeringar, men har där så bedömts vara möjligt, baserat på de likviditets- och avkastningskrav som gäller för Mottagarfonden, valt in gröna, sociala eller hållbara obligationer. Andel gröna obligationer per den 31 december 2023 var 5,3 procent.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 14 december 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna bidrar till fastställs och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Detta analyseras och redovisas av Captor. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Captors webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

- — *Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Detta analyseras och redovisas av Captor. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Captors webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

- — *Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:* [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]

**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.

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförfordningen. Detta analyseras och redovisas av Captor. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Captors webbplats [www.captor.se](http://www.captor.se).

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Det är genom Fondens placering i Mottagarfonden som hållbarhetskriterierna har implementerats. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna samt den exkluderingsstrategi som tillämpas för Mottagarfonden, undvikit exponering mot vissa verksamheter såsom vapen, alkohol, tobak, kommersiell spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288.

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Största investeringarna      Sektor      % tillgångar      Land

|   |     |        |         |
|---|-----|--------|---------|
| Captor Perenne<br>Short-Term Bond<br>(SE0020552602) | N/A | 99,95% | Sverige |
|---|-----|--------|---------|

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20231214-20231231. Fonden startade 2023-12-14 och siffran utgör Fondens innehav i Mottagarfonden per 2023-12-31.



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har inte haft som målsättning att genomföra hållbara investeringar under perioden.

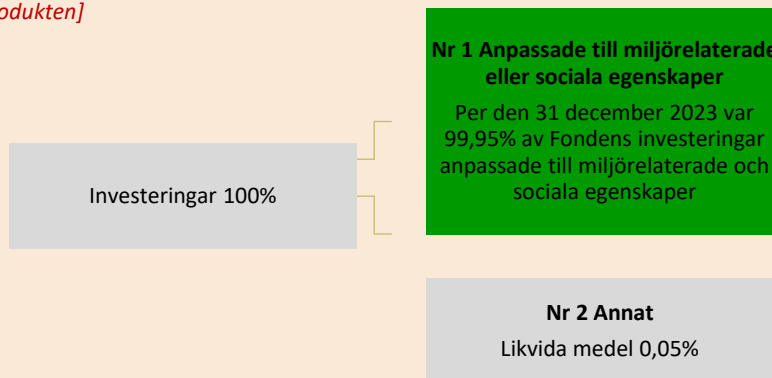
### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i Mottagarfonden per den 31 december 2023. Det bör understrykas att Fondbolaget i denna bedömning utgår från Fondens placering i Mottagarfonden (som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosuresförordningen) och inte Mottagarfondens underliggande placeringar. För information om Mottagarfondens tillgångsallokering se [www.captor.se](http://www.captor.se).

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.



[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Finans                        | 100,0%       |
| Teknik                        | 0,0%         |
| Industri                      | 0,0%         |
| Hälsovård                     | 0,0%         |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 0,0%         |
| Fastigheter                   | 0,0%         |
| Telekommunikation             | 0,0%         |
| Dagligvaror                   | 0,0%         |
| Material                      | 0,0%         |
| Kraftförsörjning              | 0,0%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxid snåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

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

**Omställningsverksamheter** är verksamheter som det ännu inte finns koldioxid snåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

[inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket 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.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin? [inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

### Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?

Ja [ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]

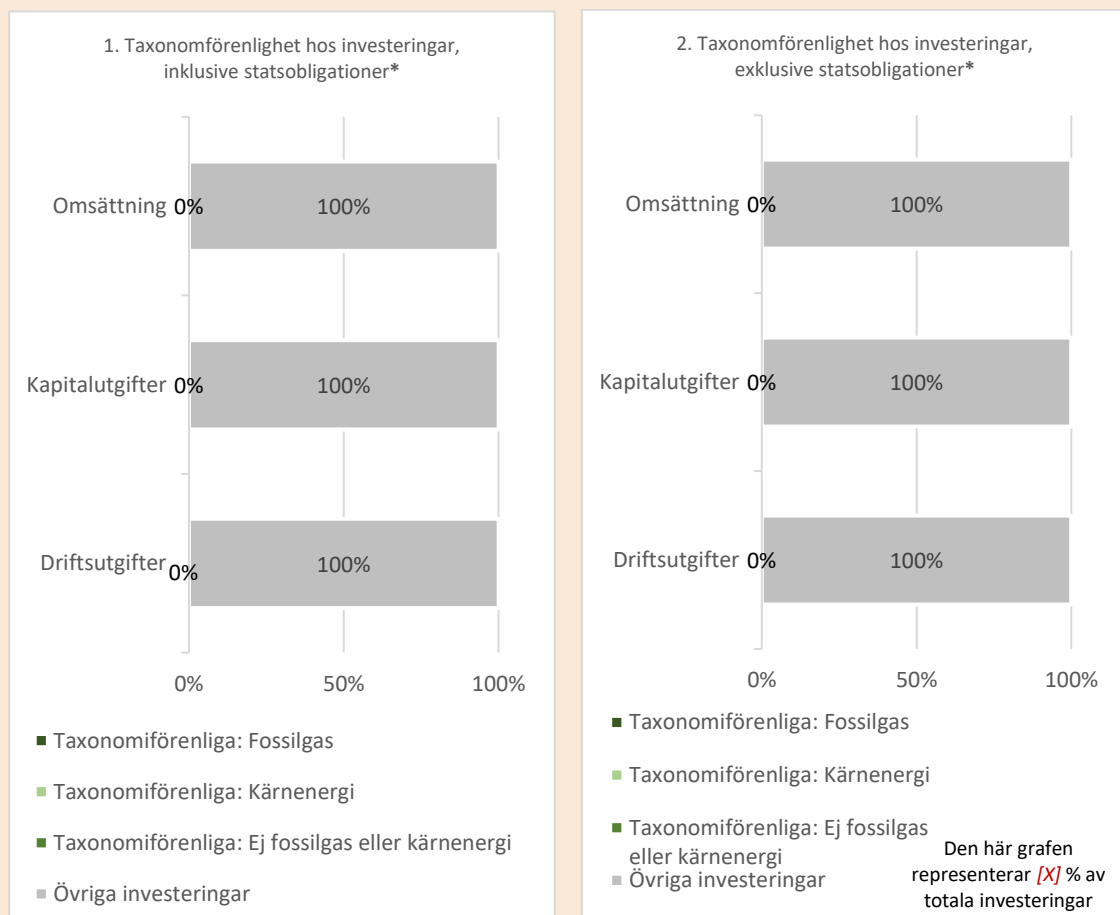
I fossilgas

I kärnenergi

Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Fonden hade per den 31 december 2023 heller inte någon exponering vare sig mot omställningsverksamheter eller möjliggörande verksamheter.

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Fonden startade den 14 december 2023. Denna rapport utgör den första som lämnas för Fonden, varför en jämförelse mot tidigare perioder inte är möjlig.



- **Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



- **Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



- **Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



- **Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden. Fondbolaget följer kontinuerligt upp Mottagarfonden och Captor för att säkerställa efterlevnad av Fondens hållbarhetskriterier.

*[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]*



### **Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?**

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

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

## 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.

## BILAGA IV

### Mall som avser regelbundna upplysningar 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

Produktnamn: Avanza Småbolag by Skoglund

Identifieringskod för juridiska personer: SE0015194618

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering? *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorde 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 gjorde hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%

Den främjade miljörelaterade och sociala egenskaper och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 främjade miljörelaterade och sociala egenskaper, men gjorde inte några hållbara investeringar



## I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt? *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

*[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Småbolag by Skoglund ("Fonden") är en matarfond som placerar i mottagarfonden FE Småbolag Sverige ("Mottagarfonden").

Mottagarfonden är en aktivt förvaltd aktiefond. I den bolagsanalys som positionstagandet i Mottagarfonden grundar sig på utgör hållbarhetspekter och främjande av miljörelaterade och sociala egenskaper betydande parametrar. Bolagsanalysen inbegriper såväl en kvalitativ som kvantitativ analys av *Environmental*-, *Social*- samt *Governance*-aspekter ("ESG"). Bolag som bedöms ge ett positivt ESG-avtryck kommer väljas in i Mottagarfonden och omvänt. Genom Fondens placering i Mottagarfonden, liksom de exkluderingskriterier som tillämpas för Mottagarfonden, har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Under perioden har Mottagarfonden valt bort placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter som vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, kommersiell spelverksamhet, pornografi och fossila bränslen (kol, olja, gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. (Företag där mottagarfondbolaget inte ser förändringsvilja eller bedömer att företagen inte kommer att komma till rätta med problemen under en acceptabel tidshorisont, underkänns för investering.)

Mottagarfondens fondbolag, FCG Fonder AB ("FCG"), har under perioden bedrivit ett påverkansarbete för Mottagarfondens räkning. En redogörelse av aktieägarengagemanget i Mottagarfonden publiceras årligen på [www.fcgfonder.se](http://www.fcgfonder.se).

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

### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

#### Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från vapen och krigsmateriel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från alkohol, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från spel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från spel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från pornografi, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Brott mot FN Global Compact

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** *[inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.



***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

***Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?***

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

***Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklARATION om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]***

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

***[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]***

***I EU-taxomin fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxominns mål, och åtföljs av särskilda unionskriterier.***

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.***

**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.



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Det är genom Fondens placering i Mottagarfonden och den hållbarhetsanalys som integrerats i investeringsbesluten rörande Mottagarfonden som hållbarhetskriterierna har implementerats. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna samt den exkluderingsstrategi som tillämpas för Mottagarfonden, undvikit exponering mot vissa verksamheter såsom kärnvapen, vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, kommersiell spelverksamhet, pornografi liksom kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer relaterade till miljöfrågor, mänskliga rättigheter, arbetsrätt och bekämpning av korruption och mutor. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Utöver de verksamheter som valts bort i enlighet med exkluderingsstrategin har indikatorer inom områdena växthusgasutsläpp, energieffektivitet, vatten, avfall, sociala och arbetsrättsliga frågor, mänskliga rättigheter, miljö, bekämpning av korruption och mutor använts för att identifiera och prioritera huvudsakliga negativa konsekvenser. Genom dessa indikatorer har förvaltaren kunnat hantera negativa konsekvenser genom att använda sitt inflytande för att påverka bolag i hållbarhetsrelaterade frågor. Påverkan har skett i egen regi och/eller i samarbete med andra aktörer. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Största investeringarna      Sektor      % tillgångar      Land

| Största investeringarna            | Sektor | % tillgångar | Land    |
|------------------------------------|--------|--------------|---------|
| FE Småbolag Sverige (SE0014958187) | N/A    | 99,91%       | Sverige |

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

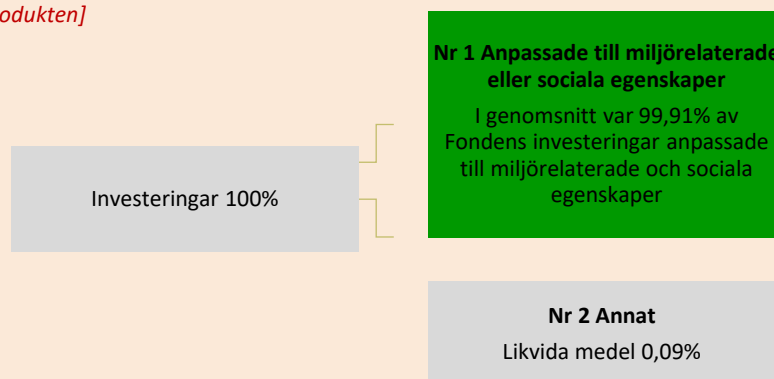
Fonden har inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar under perioden.

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i Mottagarfonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolaget i denna bedömning utgår från Fondens placering i Mottagarfonden (som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosureförordningen) och inte Mottagarfondens underliggande placeringar. För information om Mottagarfondens tillgångsallokering se [www.fcgfonder.se](http://www.fcgfonder.se).

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Industri                      | 43,2%        |
| Fastigheter                   | 13,2%        |
| Hälsovård                     | 12,1%        |
| Teknik                        | 8,4%         |
| Telekommunikation             | 7,8%         |
| Dagligvaror                   | 5,9%         |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 4,4%         |
| Material                      | 3,0%         |
| Finans                        | 2,1%         |
| Kraftförsörjning              | 0,0%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxid snåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

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

**Omställningsverksamheter** är verksamheter som det ännu inte finns koldioxid snåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

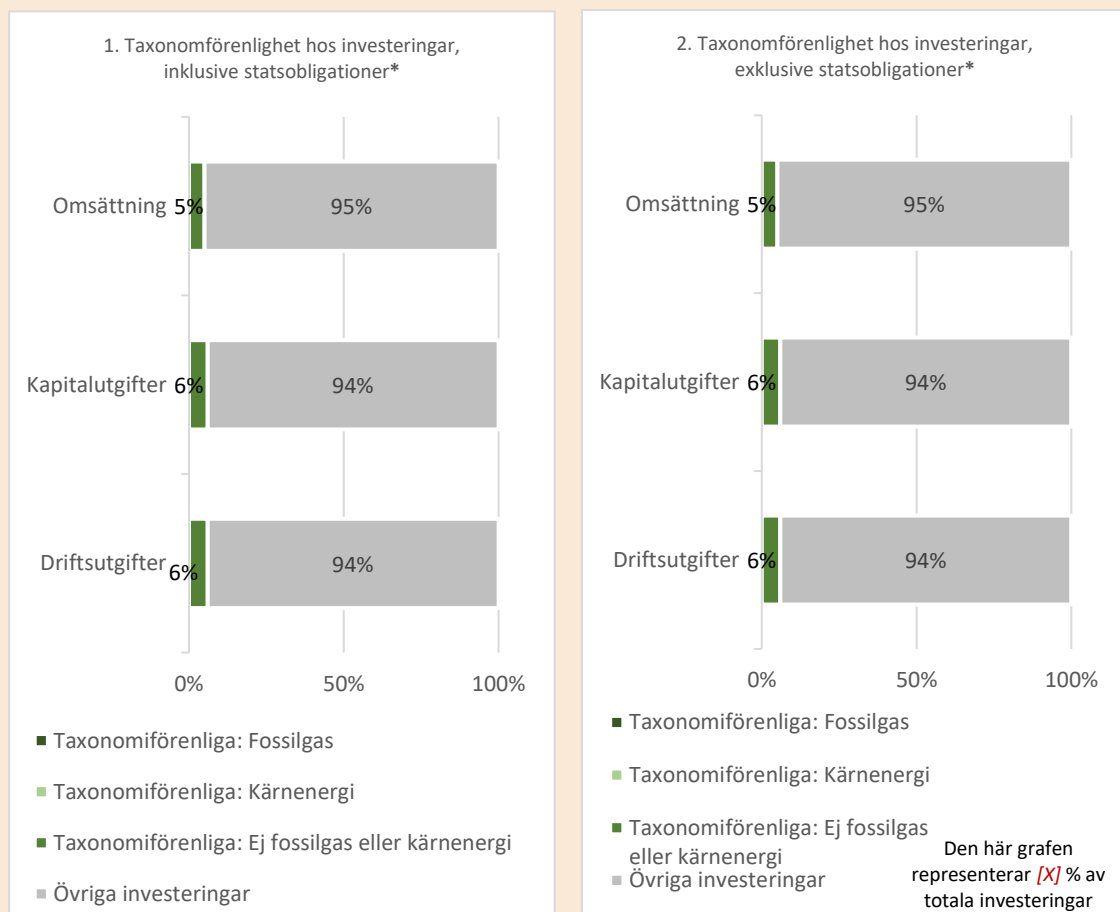
I fossilgas

I kärnenergi

Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 2 procent av Fondens värde (indirekt genom Fondens

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

placering i Mottagarfonden) placeringar i omställningsverksamheter och 7 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



### **Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?**

[inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



### **Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



### **Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



### **Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?**

[räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp Mottagarfonden och mottagarfondbolaget för att säkerställa efterlevnad av Fondens hållbarhetskriterier.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.



**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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza Sverige

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0014956850

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål:** \_\_\_\_%

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza Sverige ("Fonden") är en passivt förvaltd aktiefond vars målsättning är att följa utvecklingen för jämförelseindexet *Morningstar Sweden Sustainability Select 70 Index* ("jämförelseindex").

För jämförelseindex tillämpas en metodik för bedömning och gradering av miljörelaterade, sociala och styrningsrelaterade risker ("ESG-risker"). Detta innebär att det i Fondens jämförelseindex ingår sådana företag som har låga hållbarhetsrisker, medan företag med höga hållbarhetsrisker exkluderas i jämförelseindex. Därutöver tillämpas en exkluderingsstrategi för jämförelseindex som innebär att vissa verksamheter väljs bort.

Genom att Fonden placerar i de företag som ingår i jämförelseindex har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Fonden har under perioden valt bort placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter som vapen, krigsmateriel, alkohol, tobak, spel, pornografi, GMO, kärnkraft, cannabis och fossila bränslen (kol, olja, gas)
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact
- företag som är inblandade i betydande kontroverser (uppgående till 4 eller 5 på Sustainalytics femgradiga skala över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle)
- företag med hög ESG-risk (Sustainalytics ESG risk score >40)

För Fondens räkning har även ett påverkansarbete bedrivits under perioden i syfte att påverka utvalda bolag i en mer hållbar riktning och begränsa hållbarhetsrisker.

#### ● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

##### Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

##### Andel av intäkter från vapen och krigsmateriel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

##### Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från alkohol, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

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

Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från spel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från pornografi, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från GMO

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från GMO, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från kärnkraft

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från kärnkraft, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från cannabis

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från cannabis, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Nivå på kontroverser i företagen enligt Sustainalytics femgradiga skala över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag som klassificerats som 4 eller 5 på Sustainalytics femgradiga skala över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Nivå på miljörelaterade, sociala och styrningsrelaterade risker (Sustainalytics ESG Risk Score)

Resultatet har, genom att Fonden uteslutande placerat i företag med låg ESG-risk, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

- **Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?**

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

- **Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning:** [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklARATION om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

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

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*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 unionskriterier.*

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.*



### **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Fondens hållbarhetskriterier har implementerats genom det jämförelseindex som fastställts för Fonden och utgör en ram för vilka placeringar Fonden kan göra. Fonden har under perioden undvikit exponering mot verksamheter såsom bland annat, vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, spel, pornografi, GMO, kärnkraft, cannabis, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Genom Fondens exkluderingar av företag med verksamhet relaterad till kontroversiella vapen, företag med betydande intäkter från fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner bedöms även Fondens påverkan på andra PAI-indikatorer ha begränsats. Exempelvis bedöms Fondens undvikande av exponering mot fossila bränslen indirekt begränsa Fondens påverkan på PAI-indikatorer relaterade till utsläpp av växthusgaser.

Fondbolaget har under perioden bedrivit ett påverkansarbete för Fondens räkning. I detta påverkansarbete bedöms Fondbolaget ha bidragit till att begränsa påverkan på ytterligare PAI-indikatorer, såsom exempelvis indikatorer rörande sociala förhållanden och personalfrågor.

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör den finansiella produktens största andel investeringar under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna              | Sektor            | % tillgångar | Land    |
|--------------------------------------|-------------------|--------------|---------|
| Hennes & Mauritz B<br>(SE0000106270) | Sällanköpsvaror   | 4,41%        | Sverige |
| Assa Abloy B<br>(SE0007100581)       | Industri          | 4,09%        | Sverige |
| Handelsbanken A<br>(SE0007100599)    | Finans            | 3,94%        | Sverige |
| SCA B<br>(SE0000112724)              | Material          | 3,40%        | Sverige |
| Investor B<br>(SE0015811963)         | Finans            | 3,10%        | Sverige |
| Hexagon B<br>(SE0015961909)          | Teknik            | 2,80%        | Sverige |
| Epiroc A<br>(SE0015658109)           | Industri          | 2,69%        | Sverige |
| Nibe B<br>(SE0015658109)             | Industri          | 2,65%        | Sverige |
| EQT<br>(SE0012853455)                | Finans            | 2,63%        | Sverige |
| Atlas Copco A<br>(SE0017486889)      | Industri          | 2,60%        | Sverige |
| Telia Company<br>(SE0000667925)      | Telekommunikation | 2,53%        | Sverige |
| Securitas B<br>(SE0000163594)        | Industri          | 2,08%        | Sverige |
| Industrivärden A<br>(SE0000190126)   | Finans            | 2,02%        | Sverige |
| Industrivärden C<br>(SE0000107203)   | Finans            | 1,97%        | Sverige |
| Castellum<br>(SE0000379190)          | Fastigheter       | 1,97%        | Sverige |



**Tillgångsalloker**  
**ing** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har under perioden inte haft som målsättning att genomföra hållbara investeringar.

### ● **Vad var tillgångsallokeringen?**

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året.

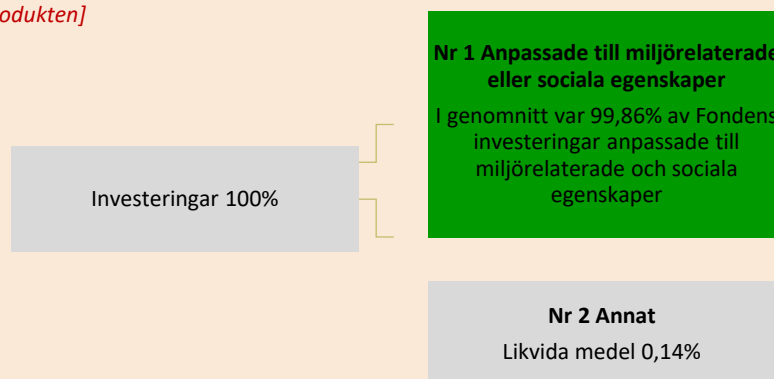
*[inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Industri                      | 27,4%        |
| Finans                        | 22,7%        |
| Fastigheter                   | 14,1%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 9,0%         |
| Telekommunikation             | 8,0%         |
| Hälsovård                     | 5,6%         |
| Teknik                        | 5,6%         |
| Material                      | 5,5%         |
| Dagligvaror                   | 1,3%         |
| Kraftförsörjning              | 0,8%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.





**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

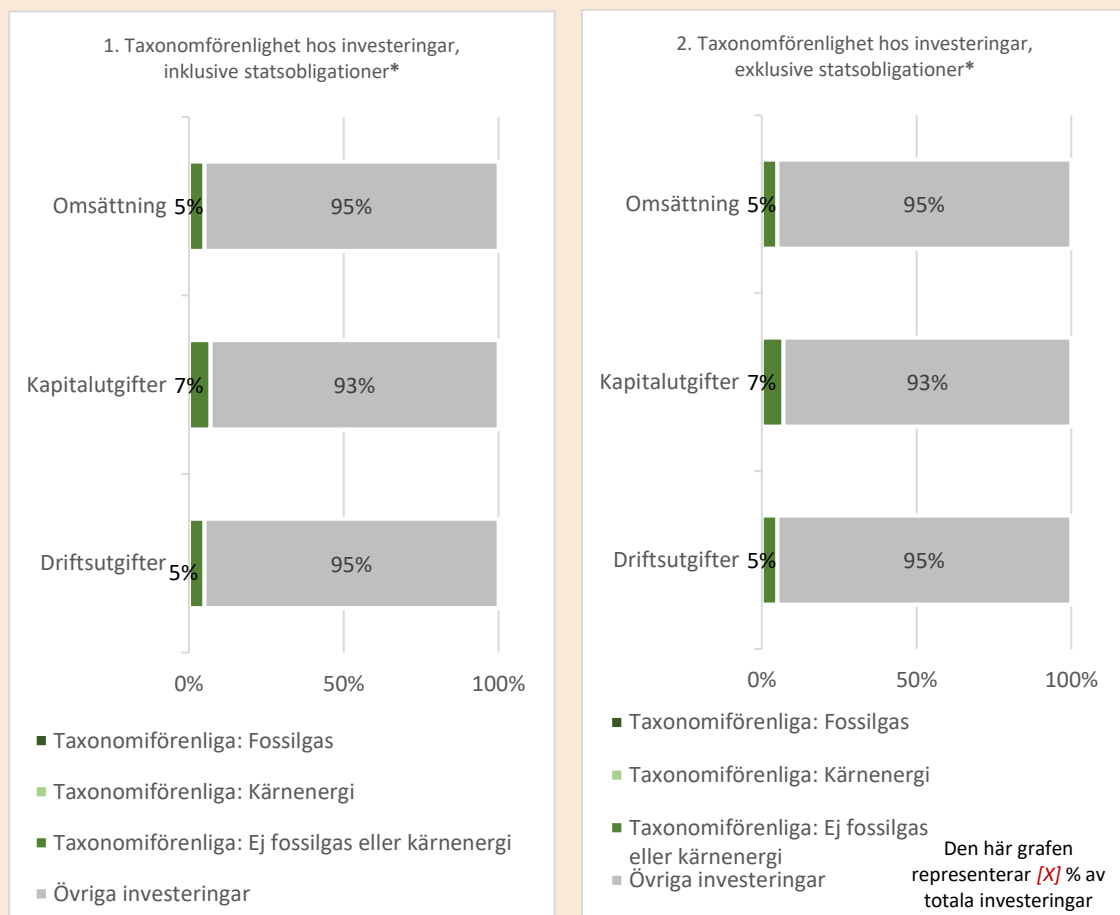
*[inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

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.

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per den 31 december 2023 emellertid 1 procent av Fondens värde placeringar i omställningsverksamheter och 8 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden placerat dess medel i företag som ingår i jämförelseindex. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp placeringarna för att säkerställa uppfyllnad av Fondens hållbarhetskriterier.

Därutöver har, där så bedömts vara möjligt, ett påverkansarbete bedrivits under perioden i syfte att påverka bolag i en mer hållbar riktning.

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.



## Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

### ● Hur skiljer sig referensvärdet från ett brett marknadsindex?

I jämförelseindex ingår ett urval av företag som även finns i det bredare Morningstar Sweden Index. I jämförelseindex väljs företag, som enligt Sustainalytics ESG Risk Rating-metodik bedöms ha höga hållbarhetsrisker, bort. Företagen som i sin tur bedöms ha lägst hållbarhetsrisker väljs in i jämförelseindex.

Följande typer av företag exkluderas från jämförelseindex:

- Företag med intäkter från kontroversiella vapen
- Företag med mer än 5 procent intäkter hänförliga till kärnvapen, vapen, krigsmateriel, alkohol, tobak, spel, pornografi, GMO, kärnkraft, cannabis och fossila bränslen
- Företag som är involverade i allvarliga ESG-relaterade kontroverser som uppgår till 4 eller 5 på Sustainalytics femgradiga skala
- Företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact
- Företag med hög ESG-risk (Sustainalytics ESG risk score >40)

### ● Vilket resultat hade denna finansiella produkt när det gäller hållbarhetsindikatorerna för att bestämma referensvärdets anpassning till de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas?

Resultatet för hållbarhetsindikatorerna var under perioden linje med de miljörelaterade och sociala egenskaper som främjas av Fonden.

### ● Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

Fondens sammansättning har på kontinuerlig basis anpassats i förhållande till sammansättningen för jämförelseindex. Fonden har i genomsnitt till 99,75 procent varit investerad i de i jämförelseindex ingående aktierna.

### ● Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med det breda marknadsindexet?

I jämförelseindex väljs de företag, som av Sustainalytics bedöms ha lägst hållbarhetsrisker, in i jämförelseindex, motsvarande 75% av det investeringsbara universet (Morningstar Sweden Index), innebärandes att 25% av företagen har exkluderats.

*[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.

**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-taxonomi 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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

Produktnamn: Avanza USA

Identifieringskod för juridiska personer: SE0012741163

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

Ja

Nej

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%**

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **gjorde inte några hållbara investeringar**



**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza USA ("Fonden") är en matarfond som placerar i mottagarfonden Amundi Index MSCI USA SRI PAB ("Mottagarfonden"). Mottagarfonden förvalts i syfte att efterbilda sammansättningen av dess jämförelseindex. Mottagarfondens jämförelseindex är utformat så att det efterlever minimikraven i EU Paris-aligned benchmarks ("PAB"). Detta innebär bland annat att den vägda genomsnittliga växthusgasintensiteten, sammantaget för de företag som ingår i jämförelseindex, är reducerad till minst hälften av växthusgasintensiteten för företag i en referensportfölj. Därtill ska de företag som ingår i jämförelseindex sammantaget uppvisa en minskning av växthusgasintensitet motsvarande minst sju procent på årsbasis. Mottagarfondens jämförelseindex innehåller vidare de företag med högst *Environmental-, Social- och Governance* ("ESG")-betyg inom varje branschsektor och som därmed bedöms agera föredömligt vad gäller hantering av miljö-, sociala- och bolagsstyrningsrelaterade risker och möjligheter.

Genom Fondens placering i Mottagarfonden, liksom de ytterligare exkluderingskriterier som tillämpas för Mottagarfonden, har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Under perioden har Mottagarfonden *valt bort* placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med mer än 5 procents intäkter hänförliga till civila skjutvapen, konventionella vapen, GMO, kärnkraft och tobak
- företag med mer än 5 procents intäkter hänförliga till produktion/ägarskap av alkohol, pornografi, och spelverksamhet, där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning av nämnda verksamheter.
- företag med mer än 5 procents intäkter hänförliga till kolkraftproduktion
- företag med mer än 30 procents intäkter från olje- och gasbaserad kraftproduktion.
- företag med allvarliga ESG-relaterade kontroverser som uppgår till mellan 0 och 3 på en tiogradig betygsskala (där 0 är sämst respektive 10 bäst) över incidenter med negativ inverkan för ägare och samhälle i enlighet med internationella normer och konventioner som FN:s allmänna förklaring om de mänskliga rättigheterna, ILO:s deklARATION om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och FN:s Global Compact.

Mottagarfondens fondbolag, Amundi Luxembourg S.A ("Amundi"), har under perioden bedrivit ett påverkansarbete för Mottagarfondens räkning. För närmare information se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

*Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen*

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från civila skjutvapen, konventionella vapen och krigsmaterial

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från civila skjutvapen, konventionella vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från GMO

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från GMO, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från kärnkraft

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från kärnkraft, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från utvinning av fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från produktion/ägarskap av alkohol samt där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från produktion/ägarskap av pornografi samt där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från spel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från produktion/ägarskap av spel samt där de aggregerade intäkterna till mer än 15 procent är hänförliga till produktion, distribution och försäljning, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Brott mot FN Global Compact

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** [inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** [inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Målen med dessa hållbara investeringar samt vilka miljömål som investeringarna bidrar till fastställs och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

- **På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna?** [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar. Fonden kan emellertid, genom dess placeringar i Mottagarfonden, få en indirekt exponering gentemot sådana investeringar som ryms inom definitionen om vad som utgör hållbara investeringar i Disclosureförordningen. Detta analyseras och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

- — **Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?**

Detta analyseras och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

- — **Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter?** Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]

Detta analyseras och redovisas av Amundi. En närmare redogörelse för det hållbarhetsarbete som tillämpas för Mottagarfonden finns på Amundis webbplats [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

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



*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*I EU-taxonomin fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonominns mål, och åtföljs av särskilda unionskriterier.*

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.*



### **Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?** *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Det är genom Fondens placering i Mottagarfonden och utformningen av Mottagarfondens jämförelseindex som hållbarhetskriterierna har implementerats. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna samt den exkluderingsstrategi som tillämpas för Mottagarfonden, undvikit exponering mot vissa verksamheter såsom, vapen, alkohol, tobak, kommersiell spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som är involverade i allvarliga ESG-relaterade kontroverser och som bryter mot internationella normer och konventioner såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. Mottagarfondens jämförelseindex utgör vidare ett så kallat *Paris-aligned benchmark*. Genom utformningen av Mottagarfondens jämförelseindex har Fondens påverkan på PAI-indikatorer såsom utläpp av växthusgaser, koldioxidavtryck samt växthusgasintensitet därtill begränsats. Amundi har för Mottagarfondens räkning bedrivit påverkansarbete under perioden i syfte att påverka företagen i miljörelaterade och sociala frågor, mänskliga rättigheter eller andra hållbarhetsfrågor som är av betydelse för samhället och den globala ekonomin.

Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

| Största investeringarna                      | Sektor | % tillgångar | Land      |
|--|--------|--------------|-----------|
| Amundi Index MSCI USA SRI PAB (LU2059754973) | N/A    | 99,96%       | Luxemburg |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

Fonden har inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar under perioden.

### ● Vad var tillgångsallokeringen?

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i Mottagarfonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolaget i denna bedömning utgår från Fondens placering i Mottagarfonden (som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosureförordningen) och inte Mottagarfondens underliggande placeringar. För information om Mottagarfondens tillgångsallokering se [www.amundi.com](http://www.amundi.com).

**Tillgångsallokering** beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Hälsovård                     | 21,0%        |
| Teknik                        | 18,1%        |
| Industri                      | 15,5%        |
| Finans                        | 13,0%        |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 12,7%        |
| Fastigheter                   | 5,9%         |
| Telekommunikation             | 4,5%         |
| Dagligvaror                   | 3,9%         |
| Material                      | 2,9%         |
| Kraftförsörjning              | 2,4%         |
| Energi                        | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

**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 annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.



## I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål

### förenliga med EU-taxonomin? *[inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6*

*första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]*

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

- Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja *[ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]*

I fossilgas

I kärnenergi

Nej

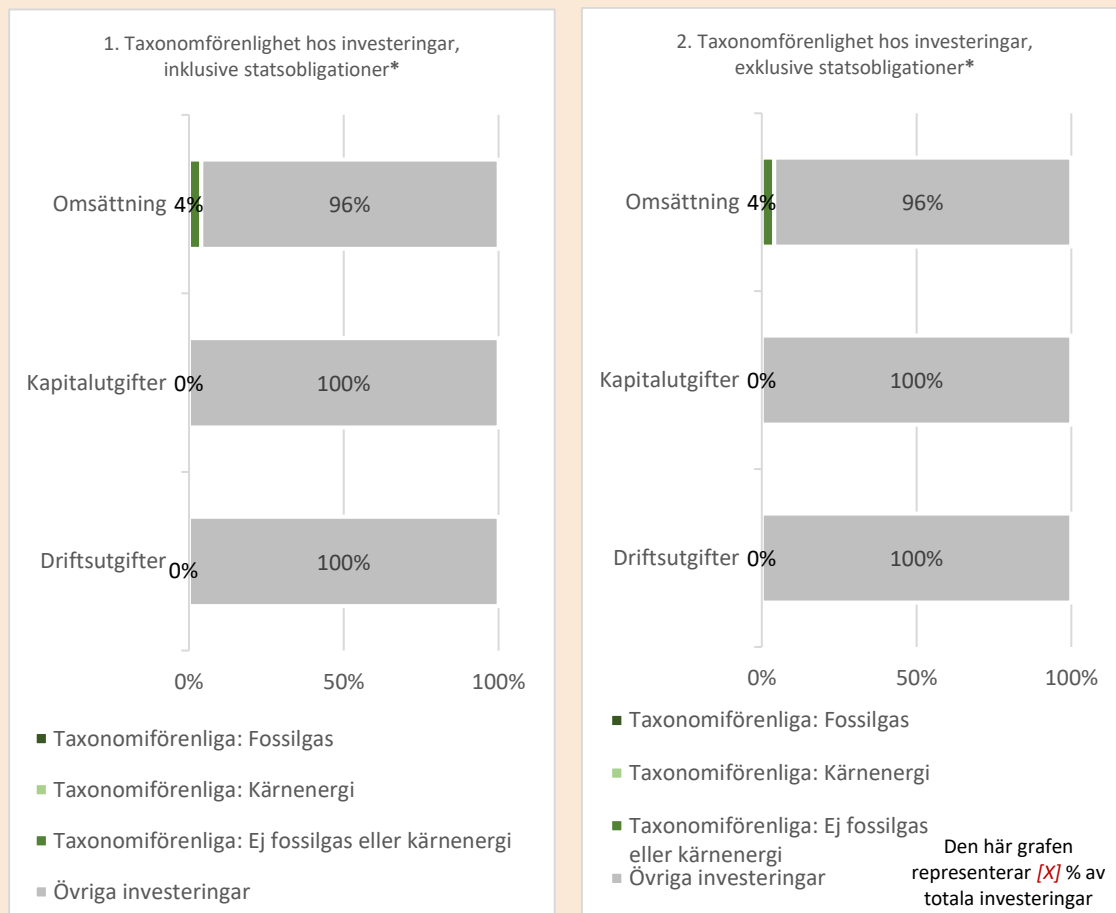
[inkludera anmärkning för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]

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.

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper

- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 4 procent av Fondens värde (indirekt genom Fondens

placering i mottagarfonden) placeringar i omställningsverksamheter och 9 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

[inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

[räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp Mottagarfonden och Amundi för att säkerställa uppfyllnad av Fondens hållbarhetskriterier.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

*[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.

**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.

## BILAGA IV

**Mall som avser regelbundna upplysningar 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**

**Produktnamn:** Avanza World Tech by TIN

**Identifieringskod för juridiska personer:** SE0014453221

## Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

**Hade denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?** *[kryssa för och fyll i efter vad som är relevant, procentsiffran återger hållbara investeringar]*

**Ja**

**Nej**

Den gjorde **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 gjorde **hållbara investeringar med ett socialt mål: \_\_\_%**

Den **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper** och även om den inte hade en hållbar investering som sitt mål, hade den en andel 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 **främjade miljörelaterade och sociala egenskaper**, men **gjorde inte några hållbara investeringar**





**I vilken utsträckning främjades de miljörelaterade och/eller sociala egenskaperna av denna finansiella produkt?** *[räkna upp de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten. För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp när det gäller hållbara investeringar med miljömål vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till. För finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar med sociala mål, räkna upp de sociala målen]*

Avanza World Tech by TIN ("Fonden") är en matarfond som placerar i mottagarfonden TIN World Tech ("Mottagarfonden"). Mottagarfonden är en aktivt förvaltd global aktiefond, inriktad mot teknikbolag vars produkter och/eller tjänster karaktäriseras av högt teknikinnehåll och bolag vars verksamhet kännetecknas av en hög grad av forskning och utveckling samt bolag med tydlig hållbarhetsinriktning. I förvaltningen av Mottagarfonden inbegrips såväl bolagsanalys som en välj in/välj ut metod vilken innebär att Mottagarfondbolaget systematiskt har inkluderat och exkluderat investeringsobjekt vars verksamheter inte överensstämmer med Mottagarfondens investeringsstrategi och hållbarhetsambition. Metoden inkluderar ESG-faktorer så som bolagsstyrningsaspekter (t.ex. aktieägares rättigheter, frågor om ersättning till ledande befattningshavare och motverkande av korruption), miljöaspekter (t.ex. företagets inverkan på miljö och klimat) samt sociala aspekter (t.ex. mänskliga rättigheter, arbetstagarrättigheter och likabehandling).

Genom Fondens placering i Mottagarfonden, liksom de exkluderingskriterier som tillämpas för Mottagarfonden, har Fonden främjat miljörelaterade och sociala egenskaper under perioden.

Under perioden har Mottagarfonden valt bort placeringar i

- företag med intäkter från kontroversiella vapen
- företag med intäkter från kärnvapen
- företag med intäkter som överstiger 5 procent från verksamheter som vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, kommersiell spelverksamhet, pornografi, fossila bränslen (kol, olja, gas) och palmolja
- företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag. (Företag där mottagarfondbolaget inte ser förändringsvilja eller bedömer att företagen inte kommer att komma till rätta med problemen under en acceptabel tidshorisont, underkänns för investering.)

Mottagarfondens fondbolag, Teknik Innovation Norden Fonder AB ("TIN Fonder"), har under perioden bedrivit ett påverkansarbete för Mottagarfondens räkning. En redogörelse av aktieägarengagemanget i Mottagarfonden publiceras årligen på [www.tinfonder.se](http://www.tinfonder.se).

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

● **Vilket resultat visade hållbarhetsindikatorerna?**

Andel av intäkter från kontroversiella vapen inklusive kärnvapen

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter från kontroversiella vapen eller kärnvapen, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

Andel av intäkter från vapen och krigsmateriel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från vapen eller krigsmateriel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från alkohol

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från alkohol, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från tobak

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från tobak, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från spel

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från spel, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från pornografi

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från pornografi, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från fossila bränslen (kol, olja, gas)

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från fossila bränslen (kol, olja, gas), under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Andel av intäkter från palmolja

Resultatet har, genom att Fonden inte haft någon exponering mot företag med intäkter överstigande 5 procent från palmolja, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

#### Brott mot FN Global Compact

Resultatet har, genom att Fonden inte exponerats mot företag med bristande efterlevnad av FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag/företag som inte bedöms vidta åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem, under perioden varit i linje med Fondens hållbarhetskriterier.

För närmare information om de hållbarhetskriterier som gäller för Fonden se förköpsinformationen som presenteras i informationsbroschyren för Fonden.

- **... och jämfört med de föregående perioderna?** *[inkludera för finansiella produkter där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]*

Inga avvikelser har noterats i förhållande till hållbarhetsindikatorerna för Fonden under aktuell period. Detta motsvarar resultatet som redovisades för föregående period.

- **Vilka var målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde, och hur bidrog den hållbara investeringen till dessa mål?** *[inkludera för finansiella produkter som gjorde hållbara investeringar, där de inte ingick i svaret på ovanstående fråga, beskriv målen. Beskriv hur de hållbara investeringarna bidrog till målet för hållbar investering.]*

*För de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852, räkna upp*

*[Inkludera en redogörelse för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852]*

*I EU-taxonomin fastställs en princip om att inte orsaka betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonominns mål, och åtföljs av särskilda unionskriterier.*

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.*

*vilka miljömål av de som fastställs i artikel 9 i den förordningen som den finansiella produktens underliggande hållbara investering bidrog till.]*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

***På vilket sätt orsakade de hållbara investeringar som den finansiella produkten delvis gjorde inte någon betydande skada för något miljömål eller socialt mål med de hållbara investeringarna? [inkludera när den finansiella produkten innefattar hållbara investeringar]***

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

*Hur beaktades indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?*

Fonden har under perioden inte haft någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

*Var de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter? Beskrivning: [inkludera en förklaring av anpassningen till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i Internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter]*

Fonden har under perioden inte haft 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.



## Hur beaktades i denna finansiella produkt huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer? *[inkludera avsnittet om det i den finansiella produkten beaktades huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer]*

Förteckningen innehåller de investeringar som utgör **den finansiella produktens största andel investeringar** under referensperioden, som är: 20230101-20231231 (årsgenomsnitt av fyra mätperioder)

Fonden har beaktat huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer ("PAI") genom de hållbarhetskriterier som Fondbolaget fastställt för Fonden. Det är genom Fondens placering i Mottagarfonden och den hållbarhetsanalys som integrerats i investeringsbesluten rörande Mottagarfonden som hållbarhetskriterierna har implementerats. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna samt den exkluderingsstrategi som tillämpas för Mottagarfonden, undvikit exponering mot vissa verksamheter såsom vapen, alkohol, tobak, palmolja, kommersiell spelverksamhet, pornografi, kontroversiella vapen, fossila bränslen samt företag som bryter mot internationella normer och konventioner. De tre sistnämnda verksamheterna utgör PAI-indikatorer som definierats i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1288. TIN Fonder har för Mottagarfonden därutöver bedrivit ett påverkansarbete.

För samtliga investeringar som genomförts av Mottagarfonden har kontroller gjorts för att säkerställa att de lever upp till de exkluderingskriterier som tillämpas för Mottagarfonden. Därutöver genomför TIN Fonder en analys av Mottagarfondens inverkan på 16 indikatorer för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer. Nämnda indikatorer omfattar områden inom utsläpp av växthusgaser, biologisk mångfald, vatten, avfall, sociala förhållanden och personalfrågor. Fondbolaget analyserar och mäter Fondens påverkan på PAI-indikatorer genom ett kvantitativt verktyg som tillhandahålls av Clarity AI. Fondbolagets funktion för riskkontroll följer upp och rapporterar Fondens påverkan på PAI-indikatorer till Fondbolagets styrelse.



## Vilka var den finansiella produktens viktigaste investeringar?

| Största investeringarna             | Sektor | % tillgångar | Land    |
|-------------------------------------|--------|--------------|---------|
| World Tech by TIN<br>(SE0014273496) | N/A    | 99,97%       | Sverige |



## Hur stor var andelen hållbarhetsrelaterade investeringar?

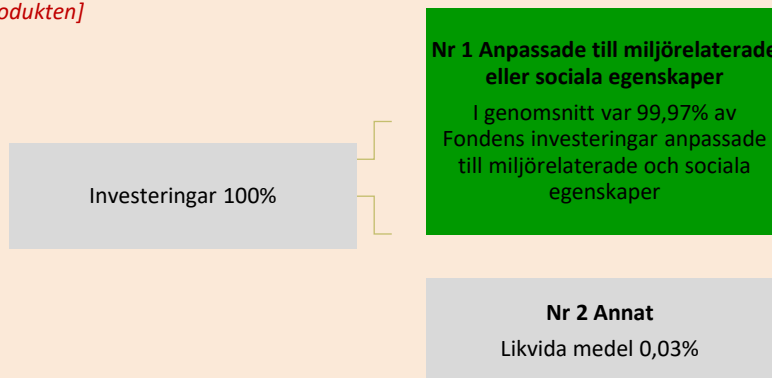
Fonden har inte haft som målsättning att genomföra hållbara investeringar under perioden.

### ● *Vad var tillgångsallokeringen?*

Fondens tillgångsallokering bestod av av tillgångar som kan motiveras tillhöra primärt Nr 1, och Nr 2. I Nr 1 ingår Fondens placeringar i Mottagarfonden. Siffrorna utgör ett genomsnitt av fyra mätperioder under året. Det bör understrykas att Fondbolaget i denna bedömning utgår från Fondens placering i Mottagarfonden (som uppfyller kraven i artikel 8 i Disclosureförordningen) och inte Mottagarfondens underliggande placeringar. För information om Mottagarfondens tillgångsallokering se [www.tinfonder.se](http://www.tinfonder.se).

**Tillgångsalloker**  
**ing** beskriver  
andelen  
investeringar i  
specifika  
tillgångar.

[Inkludera endast relevanta rutor, ta bort dem som är irrelevanta för den finansiella produkten]



**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.

● **I vilka ekonomiska sektorer gjordes investeringarna?** Meddelande enligt artikel 54 i den här förordningen.

| Sektor                        | % tillgångar |
|-------------------------------|--------------|
| Teknik                        | 51,0%        |
| Telekommunikation             | 24,7%        |
| Hälsovård                     | 24,3%        |
| Material                      | 0,0%         |
| Sällanköpsvaror och -tjänster | 0,0%         |
| Finans                        | 0,0%         |
| Fastigheter                   | 0,0%         |
| Dagligvaror                   | 0,0%         |
| Kraftförsörjning              | 0,0%         |
| Energi                        | 0,0%         |
| Industri                      | 0,0%         |

Sektorinformationen anges per 2023-12-31. Fonden har under perioden i enlighet med hållbarhetskriterierna valt bort bolag med verksamhet relaterad till icke-förnybara kolbaserade energikällor såsom fasta bränslen, naturgas och olja.

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

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till helt förnybar energi eller koldioxid snåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler.

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

**Omställningsverksamheter** är verksamheter som det ännu inte finns koldioxid snåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

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

Taxonomiförenliga  
verksamheter  
uttrycks som en  
andel av följande:

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

- **driftsutgifter**,  
som återspeglar  
investeringsobjekt  
ens gröna  
operativa  
verksamheter.



**I hur stor utsträckning var de hållbara investeringarna med ett miljömål förenliga med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt för de finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 och inkludera information i enlighet med artikel 51 i denna förordning]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar.

**Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU-taxonomin?**

Ja [ange nedan och närmare uppgifter i diagrammen i rutan]

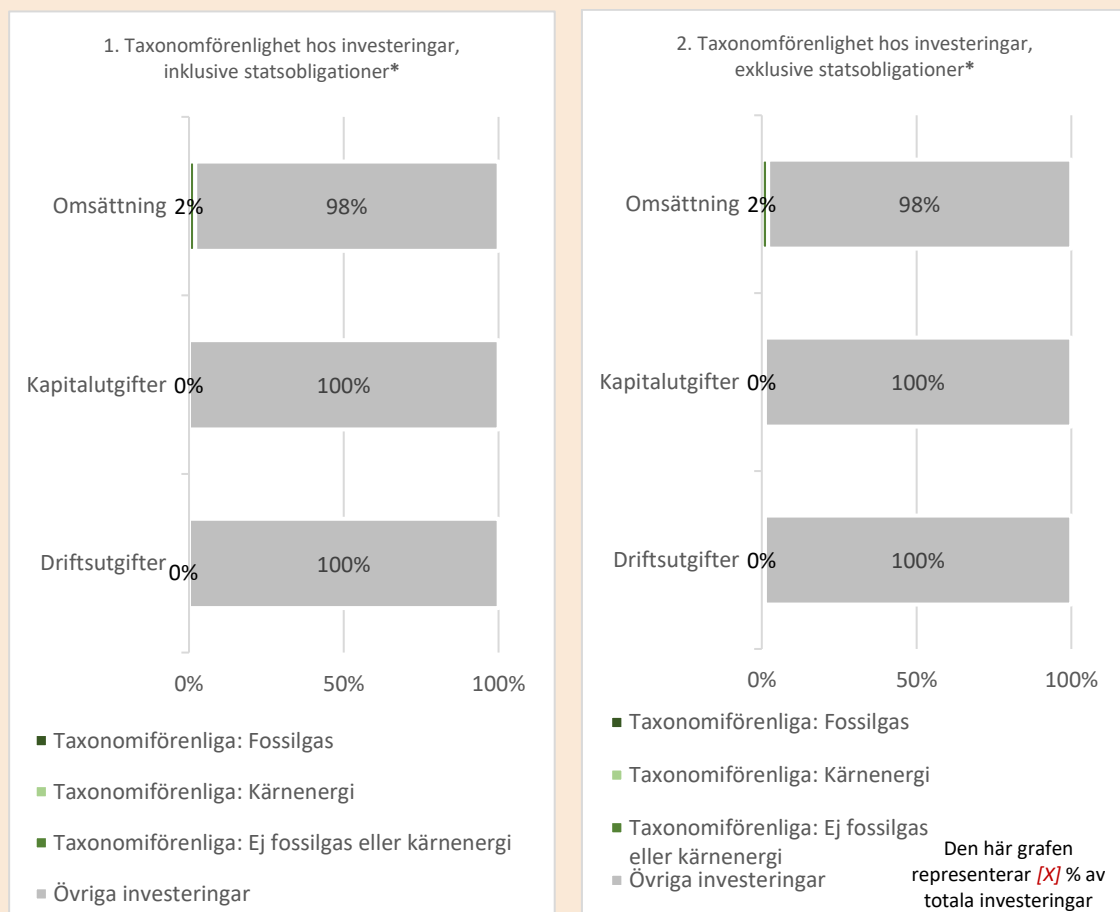
I fossilgas

I kärnenergi

Nej

Diagrammen nedan visar i grönt procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är\*, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.

[Inkludera information om taxonomiförenlig fossilgas och kärnenergi och den förklarande texten i den vänstra marginalen på föregående sida endast om den finansiella produkten har investerat i ekonomiska verksamheter som är förenliga med taxonomin under referensperioden]



\*I dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper


- **Vilken var andelen investeringar som gjordes i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?** [inkludera en uppdelning av andelarna av investeringarna under referensperioden]

Fonden har inte ett fastställt åtagande att genomföra investeringar i omställningsverksamheter och/eller möjliggörande verksamheter. Baserat på data från Clarity så utgjorde per 31 december 2023 emellertid 4 procent av Fondens värde (indirekt genom Fondens



placering i Mottagarfonden) placeringar i omställningsverksamheter och 5 procent av Fondens värde placeringar i möjliggörande verksamheter.

[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 enligt förordning (EU) 2020/852.

- **Hur stor var procentandelen investeringar som var förenliga med EU-taxonomin jämfört med tidigare referensperioder?** [inkludera där minst en tidigare regelbunden rapport tillhandahållits]

Till följd av avsaknad av data har ingen taxonomiförenlighet redovisats för Fonden tidigare, varför en jämförelse med tidigare referensperioder inte är möjlig.



**Vilken var andelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte var förenligt med EU-taxonomin?** [inkludera avsnitt endast för sådana finansiella produkter som avses i artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 där den finansiella produkten inkluderade hållbara investeringar med ett miljömål som gjordes i ekonomiska verksamheter som inte är miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter, och förklara varför den finansiella produkten investerade i ekonomiska verksamheter som inte var taxonomiförenliga]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenligt med EU-taxonomin.



**Vilken var andelen socialt hållbara investeringar?** [inkludera endast där den finansiella produkten innehöll hållbara investeringar med ett socialt mål]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden och har inte haft något åtagande att genomföra socialt hållbara investeringar.



**Vilka investeringar var inkluderade i kategorin "annat", vad var deras syfte och fanns det några miljörelaterade eller sociala minimiskyddsåtgärder?**

Fonden har under perioden inte haft något åtagande att genomföra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" har sådana likvida medel som behövdes för förvaltningen av Fonden ingått.



**Vilka åtgärder har vidtagits för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaperna under referensperioden?** [räkna upp de åtgärder som vidtagits inom den period som omfattas av den regelbundna rapporten för att uppfylla de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar, inbegripet det aktieägarengagemang som avses i artikel 3g i direktiv 2007/36/EG och allt annat engagemang som avser de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar]

Fonden har under perioden placerat dess medel i Mottagarfonden. Fondbolaget har kontinuerligt följt upp Mottagarfonden och TIN Fonder för att säkerställa efterlevnad av Fondens hållbarhetskriterier.



### Vilket resultat hade denna finansiella produkt jämfört med referensvärdet?

*[inkludera avsnitt när ett index har valts som referensvärde i syfte att uppnå de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av den finansiella produkten, och ange var den metod finns tillgänglig som används för att beräkna det valda indexet]*

*[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]*

Inget index har valts som referensvärde för de miljörelaterade och sociala egenskaper som Fonden främjar.

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

## Avanza Zero

### Transparens i fråga om integrering av hållbarhetsrisker, om negativa konsekvenser för hållbar utveckling, om främjandet av miljörelaterade eller sociala egenskaper, och om hållbar investering

- Fonden har hållbara investeringar som mål
- Fonden främjar bland annat miljörelaterade eller sociala egenskaper
- Hållbarhetsrisker integreras i investeringsbeslut, utan att fonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper eller har hållbar investering som mål
- Hållbarhetsrisker är inte relevanta (förklaring nedan)
- Huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktas
- Huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer är inte relevanta (motivering nedan)

#### Fondbolagets kommentar:

I förvaltningen av Avanza Zero ("Fonden") integreras hållbarhetsrisker i investeringsbesluten genom fondens påverkansarbete samt genom screening av det index: SIX30RX, som fonden har som målsättning att efterbilda sammansättningen av och följa. Avanza Fonder AB ("Avanza Fonder") bedriver ett påverkansarbete för fondens räkning, genom att delta på bolagsstämmor såväl som att föra dialoger med representanter för utvalda företag. Genom att agera såväl proaktivt som reaktivt i ägarstyrningen vill Avanza Fonder förstå företagens hållbarhetsrelaterade utmaningar och hållbarhetsrisker och påverka företagen i en mer hållbar riktning.

Fonden investerar i de 30 mest omsatta företagen på Stockholmsbörsen, vilka består av stora publika företag med en hög transparensgrad där hållbarhet generellt står högt på agendan och där fondbolaget har som ambition att påverka de företag som har störst betydelse för fondens avkastning samt i de fall frågor av kontroversiell karaktär uppkommer.

Fonden har som målsättning att efterbilda sammansättningen av och följa utvecklingen av SIX30RX. I SIX30RX genomförs en screening avseende internationella normer såsom FN Global Compact avseende miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och anti-korruption. I det fall det skulle uppdagas att ett företag bryter mot Global Compacts principer och inte bedöms komma tillrätta med identifierade problem kan företaget komma att uteslutas ur index. Därutöver screenas SIX30RX avseende företag med omsättning från kontroversiella vapen, vilka i sin tur exkluderas från index.

Hållbarhetsriskernas troliga negativa inverkan på fondens avkastning bedöms begränsas genom att särskilt kontroversiella företag med stora hållbarhetsrisker exkluderas från index och därmed fonden samt genom det ägarstyrningsarbete som bedrivs för fondens räkning. Det bör samtidigt noteras att index och således även Avanza Zero kan innehålla företag verksamma i branscher som kännetecknas av betydande hållbarhetsrisker som exempelvis fossila bränslen, spelverksamhet och tobak.

Fonden beaktar inte investeringarnas huvudsakliga negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer då Fondens målsättning är att följa utvecklingen för ett index som inte bedöms beakta negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer i en vidare bemärkelse.

## Information om EU:s taxonomi för miljömässigt hållbara verksamheter

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Denna fonds underliggande investeringar beaktar inte EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

## Metoder som används för att integrera hållbarhetsrisker, främja miljörelaterade eller sociala egenskaper eller för att uppnå ett hållbarhetsrelaterat mål:

### Fonden väljer bort

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

Klusterbomber, personminor

Fondbolagets kommentar:

Screening av bolag genomförs i fondens jämförelseindex.

Kemiska och biologiska vapen

Fondbolagets kommentar:

Screening av bolag genomförs i fondens jämförelseindex.

Kärnvapen

Fondbolagets kommentar:

Screening av bolag genomförs i fondens jämförelseindex.

Internationella normer

Internationella normer avser internationella konventioner, lagar och överenskommelser såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag som rör frågor om miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden investerar inte i bolag som kränker internationella normer. Bedömningen görs antingen av fondbolaget självt eller av en underleverantör.

Fondbolagets kommentar:

Fonden investerar inte i bolag som inte vidtar åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta med problemen under en tid som fondbolaget bedömer som rimlig i det enskilda fallet.

Detta alternativ avser fonder som tar fram en handlingsplan för ifrågasatta bolag, som exkluderas om angivna villkor inte uppfylls under utsatt tidsperiod.

Fondbolagets kommentar:

Screening av bolag genomförs i fondens jämförelseindex.

#### Länder

Av hållbarhetsskäl placerar inte fonden i bolag involverade i vissa länder/räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater.

Detta alternativ avser fonder som gör en landspecifik hållbarhetsanalys som resulterar i att bolag involverade i vissa länder exkluderas eller att räntebärande värdepapper utgivna av vissa stater exkluderas.

Fondbolagets kommentar:

#### Övrigt

Övrigt

Fondbolagets kommentar:

#### **Fondbolaget påverkar**

Fondbolaget använder sitt inflytande för att påverka bolag i hållbarhetsrelaterade frågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

Bolagspåverkan i egen regi

Fondbolagets kommentar:

Röstar på bolagsstämmor

Fondbolagets kommentar:

## Uppföljning av hållbarhetsarbetet

### Information om EU:s taxonomi för miljömässigt hållbara verksamheter

EU-taxonomi är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Denna fonds underliggande investeringar beaktar inte EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

## **Metoder som använts för att integrera hållbarhetsrisker, främja miljörelaterade eller sociala egenskaper eller för att uppnå ett hållbarhetsrelaterat mål:**

### **Fonden har valt in**

Fonden är en indexfond som har som mål att följa sitt jämförelseindex SIX30RX och väljer därför inte aktivt in företag.

### **Fonden har valt bort**

Fonden följer Avanza Fonders instruktion för ansvarsfulla investeringar. En screening genomförs för fondens jämförelseindex SIX30RX avseende kontroversiella vapen och företag som bryter mot internationella normer så som FN Global Compact och lagstiftning om miljö, mänskliga rättigheter, arbetsrelationer, anti-korruption. Under året har denna screening inte resulterat i att något företag har exkluderats från fondens jämförelseindex eller från fonden.

### **Fonden har påverkat**

Avanza Fonder har för fondens räkning under 2023 röstat på bolagsstämmor för totalt sex av fondens innehav (totalt fem företag). Avanza Fonder har även fört dialoger med utvalda företag i hållbarhetsrelaterade frågor i syfte att bättre förstå företagens hållbarhetsrelaterade risker och möjligheter och påverka dem i en mer hållbar riktning. Dialoger har även förts med några av bolagen inför röstningar, där Avanza Fonder valt att rösta emot bland annat ansvarsfrihet för VD och styrelse i Ericsson. Detta i syfte att markera mot en bristande transparens och kommunikation kring de påstådda allvarliga korruptionsbrott och compliance-överträdelser som uppdagats i Ericsson och som lett till att bolaget tappat en betydande andel av sitt börsvärde. Under året har dialoger förts via möten och mail med utvalda företag.

## **Övergripande kommentar om hållbarhetsarbetet**

### **Övergripande kommentar om hållbarhetsarbetet**

Avanza Fonder har under 2023 fortsatt arbetet med att utveckla sin hållbarhetsstrategi. Avanza Fonder är sedan februari 2018 medlemmar i UNPRI, Principles for Responsible Investment och har under året genomfört en rapportering i enlighet med PRI:s principer och riktlinjer.

Under det gångna året har fortsatt stort fokus lagts på EU-regelverk inom hållbarhet såsom Europaparlamentets och rådets förordning (EU) 2019/2088 av den 27 november 2019 om hållbarhetsrelaterade upplysningar som ska lämnas inom den finansiella tjänstesektorn ("Disclosureförordningen") som började tillämpas den 10 mars 2021 och där nivå 2-regler började tillämpas den 1 januari 2023.

Under året har Avanza Fonder lanserat totalt fem nya fonder. Tre av dessa fonder utgör fonder som främjar miljörelaterade och sociala egenskaper i enlighet med artikel 8 i Disclosureförordningen samt två av fonderna utgör fonder som har hållbara investeringar som mål i enlighet med artikel 9 i Disclosureförordningen.

Avanza Fonder ser löpande över och arbetar med att utveckla sin hållbarhetsstrategi för samtliga fonder under dess förvaltning.