

Sustainability-related disclosures



För finansiella produkter som främjar miljömässiga eller sociala egenskaper ska finansmarknadsaktörerna offentliggöra den information som avses i artikel 10.1 i förordningen om offentliggörande av hållbar finansiering ("SFDR") och artiklar 25 till 36 i förordning EU 2022/1288 ("SFDR RTS") i nedanstående ordningsföljd och bestående av nedanstående avsnitt (a) till (l).

Detta dokument ger dig information om denna delfond i relation till **SFDR**. Faktabladet är inte reklammaterial. Det är information som krävs enligt lag för att hjälpa dig förstå delfondens hållbarhetsegenskaper. Du rekommenderas att läsa det tillsammans med annan relevant dokumentation om denna delfond så att du kan fatta ett välgrundat beslut om huruvida du ska investera. Fondokumentation finns på Mercer Investment Solutions webbplats: <https://investment-solutions.mercer.com/global/all/en/investment-solutions-home.html>

Delfond: Mercer Passive Sustainable Global Equity UCITS CCF

Paraplyfond: Mercer UCITS Common Contractual Fund

Legal Entity Identifier: 549300VMHFK2ZEHGT456

Investeringsförvaltare: Mercer Global Investments Europe Limited

Publiceringsdatum: 14 maj 2024

a) Sammanfattning

The Delfondens miljömässiga och sociala egenskaper kommer att uppnås genom att följa resultatet av Solactive Sustainable Global Developed Equity EU Paris-Aligned Index ("Jämförelseindexet"). Jämförelseindex-metoden innefattar följande miljömässiga och sociala egenskaper som främjas av delfonden:

- en minskning av koldioxidutsläppen i syfte att uppnå nettonoll koldioxidutsläpp till 2050
- det investerbara universumet för jämförelseindexet bestäms efter tillämpningen av undantag som är utformade för att ytterligare främja miljömässiga och sociala hållbarhetsegenskaper och fastställa skyddsåtgärder för miljömässiga och sociala element i enlighet med EU:s Paris-anpassade riktmerkeskrav.

Delfonden främjar miljömässiga eller sociala egenskaper, men har inte som mål hållbar investering. Delfonden åtar sig att göra en minsta avsättning till hållbara investeringar. Målen för de hållbara investeringarna är att ge ett positivt bidrag till miljömål (nämligen anpassning till klimatförändringar och/eller begränsning av klimatförändringar) eller sociala mål (nämligen skydd och/eller främjande av ekonomiska, sociala och medborgerliga rättigheter). Ett företag som investerats i är en "hållbar investering" endast om det har bedömts vara i linje med investeringsförvaltarens ramverk för hållbara investeringar som beskrivs närmare nedan, dvs att investeringen anses vara: bidra positivt till ett eller flera FN:s mål för hållbar utveckling ("SDG"); inte skada något miljömässigt eller socialt mål mätt genom användning av PAI-indikatorer; och följa god förvaltningssed genom anpassning till FN:s Global Compact-principer och OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

The Delfonden förvaltas passivt och strävar efter att följa jämförelseindexets risk- och avkastningsprofil. Investeringsförvaltare väljer inte investeringar direkt, utan utser istället en specialiserad delinvesteringsförvaltare att förvalta delfonden. Vid val av delinvesteringsförvaltare tar investeringsförvaltare hänsyn till delinvesteringsförvaltarens förmåga att implementera hållbarhetsaspekterna av delfondens investeringsstrategi i sin investeringsprocess. Investeringsförvaltare övervakar delinvesteringsförvaltarens aktiviteter för att säkerställa att investeringsprocessen genomförs på en kontinuerlig basis och övervakar delfonden löpande med hjälp av delfondens kursavvikelser gentemot jämförelseindex och delfondens hållbarhetsindikatorer].

Delinvesteringsförvaltare är skyldiga att följa god förvaltningssed vid val av värdepapper för sina investeringar, och samtidigt följa risk- och avkastningsprofilen för jämförelseindex. Delfonden använder tredje parts dataleverantörer för att identifiera företag som anses bryta mot principerna för god förvaltning. Indexleverantören utesluter emittenter som den anser bryta mot UNGC:s principer.

Minst 90 % av delfonden kommer att anpassas till de miljömässiga och sociala egenskaper som främjas av delfonden genom direktinvestering. Den återstående andelen av delfonden kan inkludera kompletterande likvida tillgångar och derivat för effektiv portföljförvaltning. Delfonden kommer att investera minst 35 % i hållbara investeringar.

Delfonden kommer att mäta uppnåendet av de sociala och miljömässiga egenskaper som främjas med hjälp av specifika hållbarhetsindikatorer (som anges i avsnittet Metoder i detta dokument). Delfondens miljömässiga och sociala egenskaper och hållbarhetsindikatorerna övervakas med hjälp av data från olika dataleverantörer. Hållbarhetsindikatorerna kommer att informera om investeringsriktlinjerna som tillämpas på delfonden och är inkorporerade i investeringsefterlevnadsprocesserna före och efter handel där det är praktiskt möjligt. Formella granskningar av hållbarhetsindikatorerna kommer att genomföras av investeringsförvaltaren minst kvartalsvis som en del av den övergripande övervakningsprocessen. För mer information, se Övervakning av miljömässiga eller sociala egenskaper och avsnitten Metoder i detta dokument.

Delfonden kommer att använda tredje parts dataleverantörer och data från delinvesteringsförvaltarna för den finansiella produkten. Investeringsförvaltaren kommer också att ha kontakt med en marknadsledande datainsamlare för att säkerställa en bottom-up-analys av alla innehav och databehandling. Datakvalitet och täckning har olika utmaningar i olika länder och regioner. Viss data kan modelleras snarare än rapporterade data och data från vissa företag kan vara försenade. Dessutom är inte alla självrapporterade uppgifter oberoende verifierade. Se avsnitten Datakällor och bearbetning och Begränsningar för metoder och data för mer information.

I de flesta fall delegeras genomförandet av företagsengagemanget till de utsedda delinvesteringsförvaltarna, som uppmuntras att samarbeta med portföljbolag om väsentliga hållbarhetsrisker, negativa hållbarhetseffekter och andra ESG-frågor i syfte att förbättra långsiktig riskjusterad avkastning och stabiliteten på finansmarknaderna. Investeringsförvaltaren kan också välja att delta, när så är lämpligt, i samarbetsinitiativ för branschengagemang relaterade till de identifierade engagemangsprioriteringarna eller andra ämnen som anses vara anpassade till investerarnas bästa. Se avsnittet Engagemangspolicyer för mer information.

The Jämförelseindexet är utformat för att öka exponeringen mot positiva ESG-faktorer och förbli kompatibel med EU:s Paris-anpassade riktmärkeskrav och ge låg exponering mot koldioxidutsläpp i syfte att uppnå de långsiktiga globala uppvärmningsmålen i Parisavtalet. Jämförelseindexet, som är baserat på indexleverantörens metodik och bedömning, undantar företag med vissa exponeringsnivåer inom: (i) vuxenunderhållning; (ii) alkohol; (iii) kontroversiella vapen, (iv) civila skjutvapen; (v) fossila bränslen; (vi) hasardspel; (vii) tobaksföretag; (viii) normbaserat (UNGC och OECD:s riktlinjer) - Företag med verifierad bristande respekt för etablerade normer samt allvarliga eller mycket allvarliga kontroverser; (ix) miljö – betydande negativ påverkan på utvalda SDG. Jämförelseindex ses över och ombalanseras på åtminstone halvårsbasis. Ytterligare information om metodiken för beräkning av jämförelseindex finns på indexleverantörens webbplats www.solactive.com/indices/.