

## FÖRORDNINGEN OM HÅLLBARHETSRELATERADE UPPLYSNINGAR: ARTIKEL 10

## Global Core Fixed Income Lower Carbon ESG Screened Fund

IE00BKPWG574 (EUR, Acc.) | IE00BKPWG681 (EUR, Dis.) | IE00BKPWG798 (GBP, Acc.) | IE00BKPWG806 (GBP, Dis.) | IE00BKV0RJ68 (JPY, Dis.) | IE00BLCGQS28 (SEK, Acc.) | IE00BLFJC249 (SGD, Acc.) | IE00BKPWG913 (USD, Acc.)

## Sammanfattning

Denna fond främjar miljömässiga och/eller sociala egenskaper, men har inte hållbara investeringar som mål. Inget referensvärde har fastställts för att uppnå de miljömässiga och/eller sociala egenskaper som fonden främjar.

### Miljömässiga och/eller sociala egenskaper

Fonden strävar i allmänhet efter att investera i direkta innehav och **minst 80 % av dess investeringar är i linje med de miljöegenskaper och sociala egenskaper** som fonden främjar:

1. Lägre exponering mot bolagsemittenter och myndighetsemittenter/överstatliga emittenter med höga **växthusgasutsläpp**: Fonden minskar sin viktade genomsnittliga **koldioxidintensitetsexponering** mot bolag relativt företagsobligationsmarknaden och mot myndigheter/överstatliga emittenter relativt marknaden för myndighetsobligationer/överstatliga obligationer med minst 50 %.
2. Lägre exponering mot bolagsemittenter och myndighetsemittenter/överstatliga emittenter som äger **kol-, olje- och gasreserver**: Fonden minskar sina viktade genomsnittliga **potentiella utsläpp från reserver** mot bolag relativt företagsobligationsmarknaden och mot myndigheter/överstatliga emittenter relativt marknaden för myndighetsobligationer/överstatliga obligationer med minst med minst 75 %.
3. Lägre exponering mot de **högsta emittenterna bland aggregerade statskasse-/stats-/kommunemittenter**: Fonden underviktar de högsta emittenterna bland statskasse-/stats-/kommunemittenter relativt till deras vikt i fondens relevanta obligationsmarknad med minst 5 %.
4. Uteslutning av bolag med **negativ miljöpåverkan** genom väsentlig inblandning i affärsverksamhet som rör kol, olja, gas, palmolja eller fabriksodling: Uteslutningarna mäts genom att bestämma vikten för bolag med väsentlig inblandning i den angivna affärsverksamheten i fonden relativt företagsobligationsmarknaden.
5. Uteslutning av bolag med **negativ påverkan på sociala faktorer** genom väsentlig inblandning i affärsverksamhet som rör porr, alkohol, spel, tobak, skjutvapen, kontroversiella vapen (t.ex. klustervapen, personminor, kemiska och biologiska vapen och ammunition och bepansring med utarmat uran), kärnvapen eller privata fängelser: Uteslutningarna mäts genom att bestämma vikten för bolag med väsentlig inblandning i den angivna affärsverksamheten i fonden relativt företagsobligationsmarknaden.
6. Uteslutning av bolag som identifieras som verksamma på ett sätt som är oförenligt med **standarder för ansvarsfull affärsverksamhet**, såsom de som definieras i FN:s globala överenskommelse och OECD:s riktlinjer för multinationella företag, på grund av väsentlig inblandning i allvarliga kontroverser gällande miljö (t.ex. markanvändning och biologisk mångfald, giftiga utsläpp, driftsavfall eller vattenförvaltning), samhälle (t.ex. barnarbete eller mänskliga rättigheter) eller bolagsstyrning (t.ex. korruption eller bedrägeri): Uteslutningarna mäts genom att bestämma vikten för bolag som identifieras som verksamma på ett sätt som är oförenligt med standarder för ansvarsfull affärsverksamhet relativt företagsobligationsmarknaden.

Eventuella återstående investeringar kan omfatta ytterligare tillgångar, såsom likvida medel, derivat och kollektiva investeringsplaner.

Fonden är utformad för att fullfölja sina befordrade miljömässiga och/eller sociala egenskaper inom ett brett diversifierat, systematiskt och kostnadseffektivt investeringsramverk för att ge investerare möjlighet att återspegla sina hållbarhetsvärden utan att offra sunda investeringsprinciper.

Grunden för fonden är en investeringsstrategi som systematiskt är inriktad på drivkrafter för högre förväntad avkastning, inklusive löptid och kreditpremie. Fonden uppnår det målet genom att öka exponeringen mot obligationer med längre löptid (och/eller obligationer med lägre betyg) när de förväntade löptidspremierna (och/eller de förväntade kreditpremierna) är högre inom fondens investeringsinriktning.

Fonden använder en kombination av säkerhetsvikts- och uteslutningskriterier till att uppnå de miljöegenskaper och sociala egenskaper den främjar enligt ovan.

## Sammanfattning (forts.)

### Miljömässiga och/eller sociala egenskaper (forts.)

De miljömässiga och/eller sociala egenskaper och hållbarhetsindikatorer som beskrivs ovan övervakas regelbundet under fondens hela livscykel av Dimensions portföljhanteringsgrupp. Vår Compliance-avdelning använder dessutom kontroller för att verifiera att de miljömässiga och/eller sociala egenskaper som fonden främjar kontinuerligt uppnås.

Dimensional har genomfört en policy för att utvärdera förvaltningsmetoder för portföljbolag. Om ett företag inte klarar testet för god bolagsstyrning kommer Dimensions att upphöra med ytterligare investeringar i bolaget och bedöma om avyttringen är befogad.

### Uppgifter, begränsningar och due diligence

Dimensional använder uppgifter från externa leverantörer, inklusive MSCI ESG Research ("MSCI") och ISS. Dessa uppgifter kan korsrefereras och valideras för att skapa egna uppgiftsuppsättningar. Dessutom kan vi bedriva egen forskning genom att använda information från Bloomberg, rapporterade finansiella uppgifter, andra företagshandlingar, företagswebbplatser, dotterbolag, branschgrupper eller statliga enheter för att skapa interna datagrupper som kan komplettera de externa datagrupperna.

Vårt Investment Analytics and Data-team och vår Portfolio Management-grupp övervakar aktivt uppgiftskvaliteten genom en mängd automatiska valideringar, inklusive period-till-period-uppgiftsförändringar, jämförelser av uppgifter mellan flera leverantörer och mer manuella kvalitetssäkringsmekanismer.

Landskapet för miljö- och sociala uppgifter håller fortfarande på att mogna. Brist på rapporterade uppgifter från företaget är fortfarande en av de primära begränsningarna. Till exempel tenderar täckningen av rapporterade utsläpp av växthusgaser att vara lägre för små och framväxande marknadsföretag, även om utvecklingen av tillgängliga rapporterade uppgifter på dessa marknader fortsätter att förbättras. En annan begränsning är inkonsekvensen i uppgifter och metoder mellan leverantörer och företag. Dimensional undviker att förlita sig på ESG-betyg från tredje part, som ofta är subjektiva, och fokuserar istället på mer objektiva och konsekvent rapporterade mätvärden. Vi vidtar kommersiellt rimliga åtgärder för att samla in externa datagrupper och utveckla interna datagrupper som gör det möjligt för fonden att uppnå sina befordrade miljömässiga och/eller sociala egenskaper.

Dimensional följer en systematisk, processdriven investeringsstrategi som integrerar due diligence-kontroller i våra genomförings- och riskhanteringsprocesser. Som del av vår värdepappersgranskningsprocess analyserar vi informationen från prospektet, redovisningen, depositionsavtalet och vissa andra relevanta dokument för värdepapper med fast avkastning innan vi investerar i dem. Som en del av vår portföljutformning, portföljhantering och handelsprocesser genomför vi kontroller för att uppnå de miljömässiga och/eller sociala egenskaper som stöds av fonden. Ryggraden i dessa kontroller är integreringen av tillförlitliga uppgifter om miljömässiga och/eller sociala egenskaper enligt ovan. Som en del av vår riskhanteringsprocess övervakar vi dagligen alla portföljbolag för rapporter om potentiell inblandning i betydande kontroverser, inklusive ESG-relaterade kontroverser.

### Samverkanspolitik

Det som driver bolagsstyrningsförbättringar och skapar en hävstång som investerare kan använda till att hålla ledningen och styrelsen ansvariga om de inte svarar på interaktioner är framförallt mekanismen för ombudsständande på aktieägarmöten. Skuldinnehavare har vanligtvis inte någon mekanism för att påverka bolags bolagsstyrning. Men Dimensionals investeringsförvaltning för andelsägarnas räkning främjar bästa bolagsstyrningspraxis inom områden som styrelseeffektivitet, styrelseersättning och företagsintegritet, där intressena för aktie- och skuldinnehavarna ligger nära varandra.

Mer information om Dimensions allmänna engagemangsstrategi<sup>1</sup> finns i avsnittet Investment Stewardship på vår webbplats <https://www.dimensional.com/who-we-are/investment-stewardship>.

<sup>1</sup> Dimensional diskuterar styrningsfrågor med portföljbolag för att representera kundintressen. Dimensional förvärvar dock, för sina kunders räkning, oavsett sådana samtal, värdepapper enbart i syfte att investera och inte i syfte eller avsedd effekt av att ändra eller påverka kontrollen av ett portföljbolag.

Det här materialet är inte riktat till personer i jurisdiktioner där tillgängligheten av det är förbjuden eller skulle utsätta Dimensional eller dess produkter eller tjänster för krav på registrering, krav på licensiering eller andra juridiska krav inom jurisdiktionen.

”Dimensional” hänvisar till Dimensional separat men även på anknutna entiteter i allmänhet snarare än en viss entitet. De entiteterna är Dimensional Fund Advisors LP, Dimensional Fund Advisors Ltd., Dimensional Ireland Limited, DFA Australia Limited, Dimensional Fund Advisors Canada ULC, Dimensional Fund Advisors Pte. Ltd., Dimensional Japan Ltd. och Dimensional Hong Kong Limited. Dimensional Hong Kong Limited är licensierat av Securities and Futures Commission att utföra reglerade aktiviteter av typ 1 (handel med värdepapper) och tillhandahåller inga tillgångsförvaltningstjänster.

#### **OM UTFÄRDAT AV DIMENSIONAL IRELAND LIMITED**

Utfärdat av Dimensional Ireland Limited (Dimensional Ireland) med säte på 3 Dublin Landings, North Wall Quay, Dublin 1, Irland. Dimensional Ireland står under tillsyn av Central Bank of Ireland (registreringsnummer C185067).

#### **OM UTFÄRDAT AV DIMENSIONAL FUND ADVISORS LTD**

Utfärdat av Dimensional Fund Advisors Ltd. (Dimensional UK), 20 Triton Street, Regent’s Place, London, NW1 3BF, Storbritannien. Dimensional UK är auktoriserat och står under tillsyn av FCA (Financial Conduct Authority). Bolagsreferensnummer: 150100.