

Bæredygtighedsrelaterede oplysninger – Jyske Invest Bæredygtige Aktier KL

Uddrag

Dette materiale beskriver de bæredygtighedsrelaterede oplysninger, som gælder for Jyske Invest Bæredygtige Aktier KL.

Afdelingen fremmer miljømæssige og sociale karakteristika. De miljømæssige og sociale karakteristika opfyldes hovedsageligt ved, at afdelingen tilvælger selskaber, der vurderes at understøtte en bæredygtig udvikling. Samtidig ekskluderes selskaber, som ikke opfylder specifikke kriterier for bæredygtighed og ansvarlig investering. Eksklusionerne er baseret på normbaserede og aktivitetsbaserede screeningsrapporter og ESG-ratings fra eksterne data- og analyseleverandører.

Afdelingen har ikke bæredygtig investering som sit mål som beskrevet i artikel 9 i forordning 2019/2088 om bæredygtighedsrelaterede oplysninger.

Ingen bæredygtige investeringsmål

Dette finansielle produkt fremmer miljømæssige og sociale karakteristika, men har ikke bæredygtige investeringer som sit mål.

Produktets miljømæssige og sociale karakteristika

Afdelingens midler investeres under hensyntagen til specifikke principper for bæredygtighed og ansvarlig investering.

Afdelingens samlede portefølje forventes at bidrage positivt til den bæredygtige udvikling. Det sker via flere typer af til- og fravalg. Porteføljen sammensættes med fokus på relevante bæredygtighedsparametre, herunder selskabernes ESG-egenskaber, CO₂-aftryk og bidrag til FN's Verdensmål for bæredygtig udvikling. Porteføljen forventes at have en højere bæredygtighed end det globale aktiemarked. Det kommer f.eks. til udtryk ved, at porteføljen har et lavere CO₂-aftryk end sit benchmark.

Som følge af den bæredygtige investeringspolitik udelukkes endvidere en række investeringer, f.eks. i selskaber

- som opererer på en måde, der krænker bredt anerkendte internationale konventioner og normer vedrørende miljø, menneskerettigheder og forretningsetik.
- der producerer termisk kul og tjæresand.
- der er involveret i kontroversielle våben
- med meget dårlige ESG-egenskaber

For de forskellige områder anvendes der specifikke tolerancetærskler, som beskrives nærmere i informationen nedenfor.

Afdelingen fremmer miljømæssige og sociale karakteristika. Alle selskaber i porteføljen gennemgår en ESG-analyse og gennem specifikke til- og fravalg søges afdelingens investeringer rettet mod selskaber, der er bedre til at håndtere og udnytte de risici og muligheder, som den bæredygtige omstilling giver. Denne porteføljeprofil vurderes mere robust over for miljømæssige risici, og understøtter samtidig den grønne omstilling. Gennem tilvalg af selskaber, der understøtter FN's verdensmål og eksklusion af selskaber, der udviser en normbrydende adfærd hvad angår arbejdstager- og menneskerettigheder understøttes endvidere investeringernes sociale karakteristika.

Investeringsstrategi

Nedenfor defineres de bindende bæredygtighedsrestriktioner og tilvalg i afdelingens investeringsstrategi.

Porteføljen har en bæredygtig profil, der udmærker sig positivt i forhold til sit benchmark. Det kommer til udtryk ved en højere ESG-rating på porteføljen, et lavere CO₂ aftryk og et større bidrag til FN's verdensmål.

Afdelingen må ikke placere sine midler i:

- Selskaber, der opererer på en måde, der krænker bredt anerkendte internationale konventioner og normer vedrørende miljø, menneskerettigheder og forretningsetik.
- Selskaber, der producerer termisk kul og tjæresand.
- Selskaber, der er involveret i kontroversielle våben:
- Selskaber, der har en ESG-rating på CCC.
- Selskaber, der vurderes at være i klar modstrid med FN's verdensmål

De internationale normer og konventioner der screenes for brud på, er eksempelvis FN's Global Compact, OECD's retningslinjer for multinationale selskaber, FN's menneskerettighedserklæring og ILO arbejdsmarkedskonventioner om værdige forhold for arbejdstagere.

Der tages forbehold for manglende identifikation af mindre overskridelser hos enkelte selskaber.

Afdelingen følger foreningens politik for ansvarlige og bæredygtige investeringer, som sætter rammen for arbejdet med miljømæssige, sociale og ledelsesmæssige (ESG) forhold. Politikken kan findes her: [Politik for ansvarlig og bæredygtig investering i Jyske Invest](#).

Kontrol af miljømæssige og sociale karakteristika

Jyske Invest Fund Management A/S foranlediger, at der løbende foretages monitorering af afdelingen med det formål at sikre, at ovennævnte frascreeningskriterier overholdes samt at CO₂-aftryk og bidrag til FN's Verdensmål svarer til forventningerne.

Der modtages løbende en normbaseret og aktivitetsbaseret screeningsrapport for brud på internationale normer og konventioner og for brud på aktiviteter inden for termisk kul, tjæresand og kontroversielle våben. Hvis gennemgang af rapporterne viser, at selskaber bryder de bæredygtige investeringsrestriktioner, udelukkes de i afdelingens portefølje. Indholdet lægges desuden ind i et compliance-system, som blokerer for fremtidige køb af de berørte aktiver.

Metoder og datakilder

Jyske Invest Fund Management A/S anvender datakilder fra eksterne data- og analyseleverandører.

Jyske Invest Fund Management A/S samarbejder med en ekstern dataleverandør, som varetager den normbaserede screening.

For ESG-data til brug for investeringsanalysen samarbejder vi med en anden international data- og analyseleverandør. Data-leverandøren leverer selskabsanalyser, som belyser væsentlige bæredygtighedsrisici på de underliggende selskaber. Analyserne munder ud i en ESG-rating for det enkelte selskab, som kan opsummeres i en samlet ESG-rating fra AAA (bedste score) til CCC (dårligste score). ESG-ratingen viser afdelingens modstandsdygtighed overfor bæredygtighedsrisici, og selskaber med den laveste ESG-rating (CCC) udelukkes fra porteføljen.

Analyserne af hvert enkelt selskabs ESG-rating kan opsummeres i en samlet ESG-rating for afdeling og benchmark. ESG-ratingen viser afdelingens modstandsdygtighed overfor bæredygtighedsrisici. Dataleverandøren leverer

desuden data for CO₂ udledning og omsætning relateret til FN's Verdensmål, som begge indgår i selskabsvurdering og sammensætning af afdelingen. På jyskeinvest.dk kan du løbende holde dig orienteret om afdelingens bæredygtige profil.

Vi vurderer, at der med valget af anerkendte data- og analyseleverandører er taget de nødvendige skridt for at sikre afdelingens bæredygtige karakteristika.

Aktivt ejerskab

Afdelingens tilgang til aktivt ejerskab fremgår af foreningens politik for ansvarlige og bæredygtige investeringer, som kan tilgås her: [Politik for ansvarlig og bæredygtig investering i Jyske Invest](#)

Udarbejdet den 10.03.2021.