

## **Bæredygtighedsrelaterede oplysninger – Jyske Invest Aktier SRI Indeks Engros KL**

### **Uddrag**

Dette materiale beskriver de bæredygtighedsrelaterede oplysninger, som gælder for Jyske Invest Aktier SRI Indeks Engros KL.

Afdelingen markedsfører miljømæssige og sociale karakteristika. De miljømæssige og sociale karakteristika opfyldes ved, at afdelingen ekskluderer selskaber, som ikke opfylder specifikke kriterier for bæredygtighed og ansvarlig investering. Eksklusionerne er baseret på normbaseret og aktivitetsbaseret screeningsrapporter 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 markedsfører 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.

Som følge af den ansvarlige investeringspolitik udelukkes f.eks. selskaber:

- som opererer på en måde, der krænker bredt anerkendte internationale konventioner og normer vedrørende miljø, menneskerettigheder og forretningsetik
- som producerer eller distribuerer våben, alkohol, tobak, fossile brændstoffer, hasardspil og voksenunderholdning.

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

Afdelingen fremmer miljømæssige og sociale karakteristika. Gennem eksklusion af selskaber og sektorer, der anses for normbrydende og stærkt kontroversielle, herunder eksempelvis fossile brændstoffer, søges afdelingens investeringer rettet mod selskaber, der er bedre til at håndtere bæredygtighedsrisici.

Afdelingen markedsfører desuden miljømæssige mål ved at danne en porteføljesammensætning, der forventeligt indebærer et lavere CO2 aftryk end afdelingens benchmark. Denne porteføljeprofil vurderes dels mere robust over for miljømæssige risici, og understøtter samtidig klimaafbødning.

Gennem eksklusion af selskaber, der udviser en normbrydende adfærd hvad angår arbejdstager- og menneskerettigheder understøttes endvidere investeringernes sociale karakteristika.

### **Investeringsstrategi**

Nedenfor defineres de bindende bæredygtighedsrestriktioner i afdelingens investeringsstrategi.

Afdelingen må ikke placere sine midler i:

- Selskaber, der producerer og sælger våben
- Selskaber, der producerer tobak
- Selskaber, der har mere end 5 % af sin omsætning fra salg af tobak

- Selskaber, der har mere end 5 % af sin omsætning fra produktion eller salg af alkohol
- Selskaber, der har mere end 5 % af som omsætning fra produktion eller salg af voksenunderholdning
- Selskaber, der har mere end 5 % af sin omsætning fra produktion eller salg af olie, gas og kul.
- Selskaber, der bryder internationale normer eller konventioner inden for områder som miljøbeskyttelse, arbejdstagerrettigheder og menneskerettigheder.

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 [\[link\]](#).

### **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.

Der modtages løbende normbaserede og aktivitetsbaserede screeningsrapporter for brud på internationale normer og konventioner og de fastsatte aktivitetsbaserede investeringsrestriktioner ovenfor. Hvis rapporterne viser, at selskaber bryder disse internationale normer eller de fastsatte investeringsrestriktioner, udelukkes de i afdelingens portefølje.

Indholdet af rapporterne lægges ind i et compliancesystem, 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, og den aktivitetsbaserede screening tager udgangspunkt i rapporter fra en international dataleverandør.

Den internationale dataleverandør leverer tilsvarende 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). I investeringsanalysen tager den ansvarlige porteføljeforvalter udgangspunkt i vurderingen fra dataleverandøren, men porteføljeforvalteren er ikke bundet af selskabers ESG-rating.

Jyske Invest Fund Management A/S modtager tilsvarende oplysninger om porteføljens samlede ESG-rating. ESG-ratingen er baseret på data fra samme internationale dataleverandør og viser afdelingens modstandsdygtighed overfor bæredygtighedsrisici. Ud over de norm- og aktivitetsbaserede data måles der også på den samlede CO<sub>2</sub> udledning i forhold til benchmark.

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