

**NorQuant ESG** er et bærekraftig, regelstyrt fond.

Målet med NorQuant ESG er en portefølje med en solid bærekraftig profil som leverer bra avkastning. Vi integrerer derfor bruk av ESG-kriteria i våre kvantitative strategier som høster risikopremier fra anerkjente faktorer.

Disse faktorene, er egenskaper ved aksjer som forskning viser gir meravkastning over tid. Eksempler på slike faktorer er aksjer som har en lav-volatilitet (kjedelige aksjer), aksjer som viser momentum (vinneraksjer), verdiaksjer (aksjer som prises billig) og andre positive egenskaper.

NorQuants algoritmer kombinerer disse faktorene i en integrert tilnærming for å sette sammen en portefølje av høy-kvalitets ESG-vennlige aksjer med en stabil meravkastning over tid som mål.

- ◆ **Fondet investerer** i europeiske børsnoterte aksjer.
- ◆ **NorQuant ESG** består av 100 aksjer og er dermed godt diversifisert. Fondet er «long only», og investerer ikke derivater.
- ◆ Fondet ekskluderer aksjer fra kontroversielle sektorer og investerer heller ikke i aksjer på **NBIMs eksklusjonsliste**.
- ◆ UN Global Compact scores brukes for å aktivt fremme **bærekraftige investeringer**.
- ◆ Disse ESG-scores brukes i kombinasjon med NorQuants faktormodeller for å sette sammen en optimal portefølje.
- ◆ Målet er en bærekraftig portefølje med en **høyere avkastning** enn referanseindeksen MSCI Europe ESG Universal Index.

*NorQuant Multi-Asset er et UCITS-fond med daglig likviditet, og kan handles gjennom aksjesparekonto ASK.*

*Årlig forvaltningsgebyr: inntil 1,49% / Minsteinnskudd: 100 kr*

## Investeringsfilosofi:

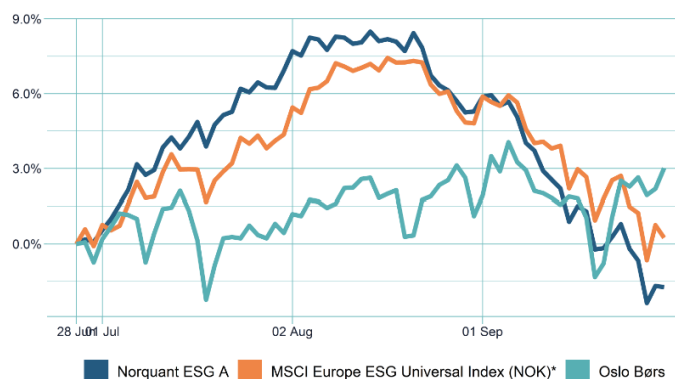
Vi ønsker å tilby private og profesjonelle investorer og tradere i Norden strategier med banebrytende datavitenskap som hovedfaktor for beslutningsprosessen. Vårt analyseteam består av PhDs og eksperter innen kvantitativ finans, maskinlæring (A.I.) og matematikk, kombinert med praktisk erfaring fra institusjonell kapitalforvaltning og trading. Vi bruker denne kunnskapen og erfaringen til å utvikle mer avanserte strategier enn det som inntil nå har vært åpent tilgjengelig for investorer og tradere i Norden.

## ESG:

Står for «**Environmental, Social and Governance**» og innebærer fokus på bærekraft, samfunnsansvar og god selskapsstyring.

Dette brukes stadig mer innen fondsstrategier og investeringsrådgivning som et filter for å unngå uetiske selskaper, og kan også hjelpe med å identifisere sektorer og selskaper som er mer utsatt for finansiell risiko eller lavere forventet avkastning.

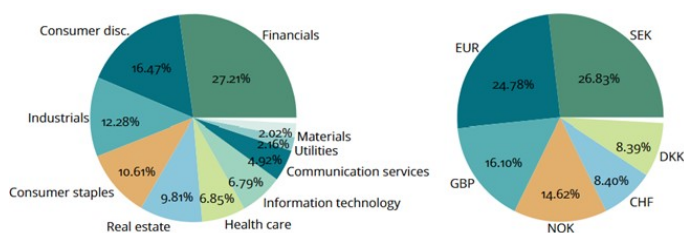
## Utvikling NorQuant ESG



Fond/Indeks	Siden start	Sist måned
NorQuant ESG	-1,7 %	-6,7 %
MSCI Europe ESG (NOK)	+0,2 %	-4,3 %
OSEBX	+3,0 %	+1,9 %

Avkastning etter kostnader

## Sektor- og valutaeksponering



## Hvorfor investere i NorQuant ESG:

- ◆ **Et bærekraftig, diversifisert fond** bestående av 100 europeiske kvalitetsaksjer.
- ◆ **Regelstyrt og vitenskapelig** forvaltning.
- ◆ Bygget på kompetanse og erfaring fra pionérene innenfor kvantitativ forvaltning fra **Oljefondet**.
- ◆ **Daglig likviditet** (kjøp/salg) og kursnotering.
- ◆ **Vårt mål er å levere meravkastning målt mot referanseindeksen.**
- ◆ NorQuant Kapitalforvaltning har konsesjon fra Finanstilsynet til porteføljeforvaltning og ordreformidling, og skal lansere nyskapende, kvantitative fond.
- ◆ Vårt andre fond er **NorQuant ESG**.