

NorQuant ESG är en väldiversifierad och hållbar aktiefond. Målet med NorQuant ESG är att skapa en portfölj med en solid hållbar profil som levererar en bra avkastning. Vi integrerar därför användningen av ESG-kriterier i våra kvantitativa strategier som drar fördel av riskpremier från erkända faktorer. Dessa faktorer är egenskaper för aktier som forskning visar ger meravkastning över tid. Exempel på sådana faktorer är aktier som har en låg volatilitet (tråkiga aktier), aktier som visar momentum (vinnaraktier), värde aktier (aktier med låg värdering) och andra positiva egenskaper.

NorQuants algoritmer kombinerar dessa faktorer i ett integrerat tillvägagångssätt för att skapa en portfölj med ESG-vänliga aktier av högsta kvalitet. Målsättningen är att skapa en stabil meravkastning över tid jämfört med fondens jämförelseindex.

- ♦ **Fonden investerar** i börsnoterade europeiska aktier.
- ♦ **NorQuant ESG** består av 100 aktier och är därmed väldiversifierad. Fonden är så kallad «long only» och investerar inte i derivat.
- ♦ Fonden undviker aktier inom kontroversiella sektorer och investerar dessutom inte i aktier på **Norges Bank Investment Managements exkluderingslista**.
- ♦ UN Global Compact scores används för att aktivt främja **hållbara investeringar**.
- ♦ Dessa ESG-poäng används i kombination med NorQuants faktormodeller för att skapa en optimal portfölj.
- ♦ Målet är en hållbar portfölj som **överträffar** jämförelseindex MSCI Europe ESG Universal Index.

*NorQuant Multi-Asset är en UCITS-fond med daglig likviditet.
Förvaltningsavgift (D): 1,49% / Min.investering: 100 SEK*

Investeringsfilosofi:

NorQuant erbjuder privatkunder och professionella investerare strategier med banbrytande datavetenskap som den viktigaste faktorn i beslutsprocessen. Analysteamet består av PhDs och experter inom kvantitativ finans, maskininläring (AI) och matematik, kombinerat med praktisk erfarenhet från institutionell kapitalförvaltning och trading. Vi använder denna kunskap och erfarenhet för att utveckla strategier som är mer avancerade än vad som hittills varit tillgängligt för investerare i Norden.

ESG:

ESG står för «**Environmental, Social and Governance**» och innebär fokus på hållbarhet, socialt ansvar och god verksamhetsstyrning. ESG används alltmer inom fondstrategier och investeringsrådgivning som ett filter för att undvika oetiska företag och för att hjälpa till att identifiera sektorer och företag som är mer utsatta för finansiell risk o/e lägre förväntad avkastning.

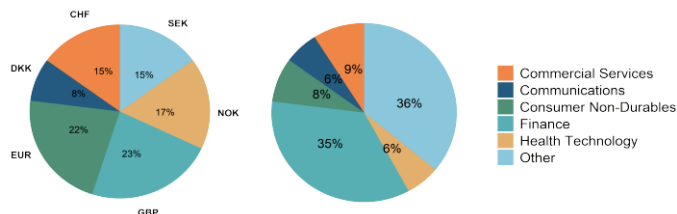
Utveckling NorQuant ESG



Fond/Index	Sedan start	Sista månaden	YTD
NorQuant ESG D*	-1,6 %	6,6 %	-8,6 %
MSCI Europe ESG (SEK)	3,0 %	4,4 %	-7,3 %

* Avkastning efter kostnader

Sektor- och valutaexponering



Varför investera i NorQuant ESG:

- ♦ **En hållbar och diversifierad fond** bestående av 100 europeiska kvalitetsaktier.
- ♦ **Regelstyrd och vetenskaplig** förvaltning.
- ♦ Bygger på kompetens och erfarenhet från pionjärerna inom kvantitativ förvaltning hos norska **Oljefonden**.
- ♦ **Daglig likviditet** (köp/sälj) och kursnotering (NAV).
- ♦ **Vårt mål är att leverera en bättre avkastning än jämförelseindex.**
- ♦ NorQuant Kapitalförvaltning har tillstånd från Finanstilsynet att bedriva portföljförvaltning och orderförmedling, samt ska lansera nyskapande kvantitativa fonder. I januari 2021 startade vi vår första fond, **NorQuant Multi-Asset**.