

NorQuant Kapitalforvaltning bærekraftpolicy

Innledning

NorQuant Kapitalforvaltning AS erkjenner betydningen av bærekraft i investeringsprosesser og er dedikert til å integrere bærekraftsrisiko og -muligheter i vår investeringsfilosofi. Dette dokumentet beskriver vår tilnærming og forpliktelser i henhold til SFDR (Sustainable Finance Disclosure Regulation) og vår overordnede investeringsfilosofi.

Rolle som finansmarkedsdeltaker

Som finansmarkedsdeltaker, forvalter vi NorQuant Multi-Asset Fondet, et UCITS fond, på oppdrag fra FCG Fonder AB. Fondet er klassifisert som et artikkel 6 fond under SFDR, noe som reflekterer vår tilnærming til å vurdere bærekraftsrisiko parallelt med andre investeringsrisikoer, uten at dette begrenser vårt investeringsunivers.

Investeringstilnærming og bærekraftsrisiko

Vår investeringstilnærming er grundet i troen på at integrering av ESG-faktorer (miljømessige, sosiale, og styringsmessige forhold) bidrar til bedre risikojustert avkastning over tid. Vi erkjenner at manglende fokus på ESG-faktorer kan medføre skjulte forpliktelser og usikkerhet rundt fremtidige inntjeningsforventninger. Derfor evaluerer vi alle potensielle investeringer med tanke på deres bærekraftsrisiko og -muligheter.

Integrering av bærekraftsrisiko i utvalg av ETF-er

NorQuant Kapitalforvaltning vurderer alle investeringer i selskapets seleksjonsprosess. Vårt investeringsunivers består av inntil 30 ETFer (børsnoterte fond), hvorav i snitt 10 er i porteføljen til enhver tid. Det har historisk vist seg å være vanskelig for selskapet å klassifisere ETFene med hensyn til bærekraft. Selskapet har til nå unnlatt å gjøre dette, men har engasjert seg i en prosess for å formalisere hvordan bærekraftsrisiko integreres når vi velger mellom ETF-er som representerer ulike aktivklasser. Dette innebærer en nøye vurdering av hvordan hver ETF forholder seg til bærekraftsrisikoer og muligheter, med et mål om å prioritere ETF-er som demonstrerer en sterkere bærekraftsprofil, gitt at de tilbyr sammenlignbar eksponering, kostnad, og likviditet.

Forholdet til FCG Fonder AB og informasjonsdeling

Som den eneste kunden og eieren av fondet vi forvalter, har FCG Fonder AB spilt en nøkkelrolle i defineringen av våre investeringsmandater. Vi arbeider tett med FCG Fonder AB for å sikre at våre investeringsstrategier er i tråd med deres forventninger og bærekraftsmål. Informasjon om vår tilnærming til bærekraft og hvordan vi integrerer bærekraftsrisiko i våre investeringsbeslutninger, er tydelig kommunisert gjennom vår nettside og i presentasjoner til potensielle kunder.

Bærekraftsrisiko og godtgjørelsespolitikk

Godtgjørelsespolitikken til NorQuant Kapitalforvaltning innebærer kun betaling av fastlønn til ansatte, og bærekraftsrisiko er ikke en del av beregningen, men inkludert i rutinen.

Oppsummering

NorQuant Kapitalforvaltning er forpliktet til å være i forkant av bærekraftige investeringer, med et klart fokus på hvordan bærekraftsrisiko og -muligheter integreres i vår investeringsprosess. Gjennom åpen dialog med våre partnere, transparent kommunikasjon om våre fond og strategier, og ved kontinuerlig å vurdere og tilpasse vår tilnærming til bærekraftsrisikoer, er selskapet forpliktet til å skape langvarig verdi for våre investorer og bidra positivt til samfunnet og miljøet. Gjennom vår dedikasjon til bærekraft, streber vi etter å lede an i kapitalforvaltningsbransjen, ikke bare som finansmarkedsdeltakere, men som aktive bidragsytere til en mer bærekraftig fremtid.