

## NorQuant Kapitalforvaltning hållbarhetspolicy

---

### Inledning

NorQuant Kapitalforvaltning AS inser vikten av hållbarhet i investeringsprocesser och är dedikerade till att integrera hållbarhetsrisiker och möjligheter i vår investeringsfilosofi. Detta dokument beskriver vårt tillvägagångssätt och våra skyldigheter enligt SFDR (Sustainable Finance Disclosure Regulation) och vår övergripande investeringsfilosofi.

### Roll som finansmarknadsaktör

Som finansmarknadsaktör förvaltar vi fonden NorQuant Multi-Asset, som är en UCITS-fond, på uppdrag av FCG Fonder AB. Fonden klassificeras som en artikel 6-fond under SFDR, vilket återspeglar vår strategi att bedöma hållbarhetsrisiker parallellt med andra investeringsrisiker, utan att detta begränsar vårt investeringsuniversum.

### Investeringsmetod och hållbarhetsrisk

Vår investeringsstrategi bygger på tron att integration av ESG-faktorer (miljö-, sociala och styrningsfaktorer) bidrar till bättre riskjusterad avkastning över tid. Vi inser att bristande fokus på ESG-faktorer kan leda till dolda skulder och osäkerhet kring framtida vinstförväntningar. Därför utvärderar vi alla potentiella investeringar utifrån deras hållbarhetsrisiker och möjligheter.

### Integrering av hållbarhetsrisiker i valet av ETF:er

NorQuant Kapitalforvaltning bedömer alla investeringar i bolagets urvalsprocess. Vårt investeringsuniversum består av upp till 30 ETF:er (börshandlade fonder), varav i genomsnitt 10 finns i portföljen vid varje given tidpunkt. Det har historiskt visat sig svårt för företaget att klassificera ETF:erna med avseende på hållbarhet. Bolaget har hittills misslyckats med detta, men har engagerat sig i en process för att formalisera hur hållbarhetsrisiker integreras när vi väljer mellan ETF:er som representerar olika tillgångsklasser. Detta innebär en noggrann bedömning av hur varje ETF förhåller sig till hållbarhetsrisiker och möjligheter, i syfte att prioritera ETF:er som visar en starkare hållbarhetsprofil, givet att de erbjuder jämförbar exponering, kostnad och likviditet.

### Relationen till FCG Fonder AB och informationsutbyte

Som enda kund och ägare till den fond vi förvaltar har FCG Fonder AB spelat en nyckelroll i att definiera våra investeringsmandat. Vi har ett nära samarbete med FCG Fonder AB för att säkerställa att våra investeringsstrategier ligger i linje med deras förväntningar och hållbarhetsmål. Information om vårt förhållningssätt till hållbarhet och hur vi integrerar hållbarhetsrisiker i våra investeringsbeslut kommuniceras tydligt via vår hemsida och i presentationer för potentiella kunder.

## Hållbarhetsrisk og ersättningspolicy

NorQuant Kapitalforvaltning's ersättningspolicy innebär endast utbetalning av fast lön till anställda och hållbarhetsrisk ingår inte i kalkylen utan ingår i rutinen.

## Sammanfattning

NorQuant Kapitalforvaltning har åtagit sig att ligga i framkanten av hållbara investeringar, med ett tydligt fokus på hur hållbarhetsrisiker och -muligheter integreras i vår investeringsprocess. Genom öppen dialog med våra partners, transparent kommunikation om våra fonder og strategier, og genom att kontinuerligt bedöma og anpassa vårt förhållningssätt till hållbarhetsrisiker, har företaget åtagit sig att skapa långsiktigt värde för våra investerare og bidra positivt till samhället og miljön. Genom vårt engagemang för hållbarhet strävar vi efter att leda kapitalförvaltningsbranschen, inte bara som finansmarknadsaktörer, utan som aktiva bidragsgivare till en mer hållbar framtid.