

**Informationen nedan presenteras i enlighet med EU-förordning 2019/2088, Förordning om hållbarhetsrelaterade upplysningar inom den finansiella sektorn (SFDR).**

### **Sammanfattning**

Denna fond främjar miljörelaterade och sociala egenskaper genom sina investeringar men har inte hållbara investeringar som mål. Det innebär att fonden bland annat tar hänsyn till miljö och klimat samt mänskliga rättigheter, arbetstagar rättigheter och likabehandling i sin investeringsanalys. Fonden avser inte att göra några hållbara investeringar i enlighet med SFDR eller investeringar som beaktar EU-taxonomin för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Fonden är en aktiefond som via investeringar i överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument tar exponering mot europeiska aktier. Fonden är att betrakta som en bred aktiefond som allokerar mellan olika typer av sektorer och storlek på bolag. Fondens målsättning är att över tid generera en genomsnittlig årlig avkastning som överstiger indexet MSCI Europe ESG Universal Index. Förvaltningen av fonden syftar till att främja bland annat miljörelaterade eller sociala egenskaper, eller en kombination av dessa egenskaper. Fonden investerar i likvida aktier handlade på de största europeiska marknaderna och uppnår därigenom en portfölj bestående av likvida aktier i bolag med hög rapporteringsstandard.

Bolagsanalysen inbegriper såväl en kvalitativ som kvantitativ analys av Environmental-, Social- samt Governance-aspekter ("ESG"). Bolag som bedöms ge ett positivt ESG-avtryck kommer väljas in i fonden och bolag som bedöms ha ett negativt ESG-avtryck kommer att exkluderas.

Utifrån denna analys exkluderas sådana bolag som förvaltaren bedömer motverkar de miljörelaterade och sociala egenskaperna. Bolag som bedöms främja sådana egenskaper kan väljas in i fonden. Fondbolaget övervakar löpande att de miljörelaterade/sociala egenskaper fonden främjar efterlevs.

### **Sammendrag**

Dette fondet fremmer miljømessige og sosiale særtrekk gjennom sine investeringer, men har ikke bærekraftige investeringer som mål. Det betyr at fondet tar hensyn til blant annet miljø og klima, samt menneskerettigheter, arbeidstakerrettigheter og likebehandling i investeringsanalysen. Fondet har ikke til hensikt å foreta bærekraftige investeringer i samsvar med SFDR eller investeringer som tar hensyn til EUs taksonomi for miljømessig bærekraftige økonomiske aktiviteter.

Fondet er et aksjefond som gjennom investeringer i omsettelige verdipapirer og pengemarkedsinstrumenter tar eksponering mot europeiske aksjer. Fondet er å anse som et bredt aksjefond som fordeler seg mellom ulike typer sektorer og størrelser på selskaper. Fondets mål er å oppnå en genomsnittlig årlig avkastning over tid som overstiger MSCI Europe ESG Universal Index. Forvaltningen tar sikte på blant annet å fremme miljømessige eller sosiale særtrekk, eller en kombinasjon av disse særtrekkene. Fondet investerer i likvide aksjer omsatt i de største europeiske markedene, og oppnår dermed en portefølje bestående av likvide aksjer i selskaper med høye rapporteringsstandarder.

Selskapsanalysen omfatter både en kvalitativ og kvantitativ analyse av miljø-, sosiale- og selskapsstyringsaspekter ("ESG"). Selskaper som vurderes å ha et positivt ESG-fotavtrykk vil bli valgt inn i fondet, og selskaper som vurderes å ha et negativt ESG-fotavtrykk vil bli utelukket.

Basert på denne analysen utelukkes selskaper som forvalteren vurderer motvirker miljømessige og sosiale egenskaper. Selskaper som vurderes å fremme slike egenskaper, kan velges inn i fondet. Fondsselskapet overvåker kontinuerlig etterlevelsen av de miljømessige / sosiale egenskapene fondet fremmer.

### **Summary**

This fund promotes environmental and social characteristics through its investments but does not have sustainable investments as its objective. This means that the fund considers, among other things, the environment and climate, as well as human rights, labour rights and equal treatment in its investment analysis.

## *Hållbarhetsrelaterade upplysningar*

### *NorQuant ESG*

The Fund does not intend to make any sustainable investments in accordance with the SFDR or investments that consider the EU taxonomy for environmentally sustainable economic activities.

The fund is an equity fund that, through investments in transferable securities and money market instruments, takes exposure to European equities. The fund is to be regarded as a broad equity fund that allocates between different types of sectors and sizes of companies. The fund's goal is to generate an average annual return over time that exceeds the MSCI Europe ESG Universal Index. The management of the fund aims to promote environmental, or social characteristics, or a combination of these characteristics. The fund invests in liquid stocks traded on the largest European markets, thereby achieving a portfolio consisting of liquid shares in companies with high reporting standards.

The company analysis includes both a qualitative and quantitative analysis of Environmental, Social and Governance aspects ("ESG"). Companies that are judged to have a positive ESG footprint will be elected to the fund and companies that are judged to have a negative ESG footprint will be excluded.

Based on this analysis, companies that the manager assesses counteract the environmental and social characteristics are excluded. Companies that are judged to promote such characteristics can be elected to the fund. The fund company continuously monitors compliance with the environmental/social characteristics the fund promotes.

### **Inga mål för hållbar investering**

Denna fond främjar miljörelaterade och sociala egenskaper genom sina investeringar men har inte hållbara investeringar som mål. Det innebär att fonden bland annat tar hänsyn till miljö och klimat samt mänskliga rättigheter, arbetstagar rättigheter och likabehandling i sin investeringsanalys. Fonden avser inte att göra några hållbara investeringar i enlighet med SFDR eller investeringar som beaktar EU-taxonomin för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Fonden investerar i noterade aktier inom EES (Europeiska ekonomiska samarbetsområdet). Det datadrivna aktieurvalet och portföljens sammansättning är regelbaserat, och har en integrerad faktorbaserad strategi. Huvudfaktorn i aktievalet baseras på ESG-poäng utifrån FN:s tio Global Compact principer som hämtas från ansedda leverantörer. Dessa poäng kombineras sedan med andra stilfaktorer (som momentum och low volatility) för att sätta ihop en optimerad portfölj med målsättningen att över tid generera en genomsnittlig årlig avkastning som överstiger indexet MSCI Europe ESG Universal Index. MSCI Europe ESG Universal Index är baserat på MSCI Europe Index (dess moderindex) och inkluderar stora och medelstora företag i över 15 utvecklade marknader (DM) i Europa. Indexet är utformat för att återspegla resultatet av en investeringsstrategi som, genom att styra bort från fritt flytande marknadsvikter, försöker få exponering mot de företag som visar både en robust ESG-profil samt en positiv trend för att förbättra den profilen med minimala undantag från MSCI Europe-indexet.

För alla investeringar i fonden genomförs, vid investeringstillfället och löpande, kontroll mot förvaltarens exkluderingskriterier för att säkerställa att inga bolag är involverade i verksamheter som förvaltaren anser oförenliga med en hållbar utveckling.

Det gäller verksamheter avseende produktion och distribution av klusterbomber, personminor, kemiska och biologiska vapen, kärnvapen, vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, pornografi, kommersiell spelverksamhet, fossila bränslen, uran samt bolag som bryter mot internationella normer och konventioner relaterade till mänskliga rättigheter, miljö, arbetsrätt eller bekämpning av korruption och mutor. Eventuella avvikelser hanteras genom exkludering.

### **Fondens miljörelaterade eller sociala egenskaper**

Fonden främjar **miljörelaterade egenskaper** såsom minskat fossilt användande, mindre föroreningar, mer hållbara produkter och mer hållbar produktion genom att välja bort investeringar i bolag med verksamhet kopplat till fossila bränslen, kärnkraft och GMO samt bolag som bryter mot internationella normer och konventioner relaterade till miljöfrågor.

## Hållbarhetsrelaterade upplysningar

### NorQuant ESG

Fonden främjar **sociala egenskaper** såsom jämställdhet och arbetsmiljöfrågor genom att välja bort investeringar i bolag som bryter mot internationella normer och konventioner relaterade till mänskliga rättigheter, arbetsrätt och bekämpning av korruption och mutor. Fonden exkluderar investeringar i bolag där mer än 5 procent av omsättningen kommer från verksamhet kopplad till förbjudna vapen, kärnvapen, vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, pornografi och kommersiell spelverksamhet samt genom att välja bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner relaterade till mänskliga rättigheter, arbetsrätt och bekämpning av korruption och mutor.

### Investeringsstrategi

Fonden är en aktivt förvaltd aktiefond. Med aktivt förvaltd avses att förvaltaren fattar egna aktiva placeringsbeslut med målsättningen att långsiktigt överträffa jämförelseindexets avkastning. Hållbarhetsanalys är en integrerad del av förvaltarnas investeringsanalys. Fonden tillämpar hållbarhetskrav i form av en exkluderingsstrategi vilket innebär att de bolag som inte uppfyller kraven för ansvarsfulla investeringar inte får ingå i fonden.

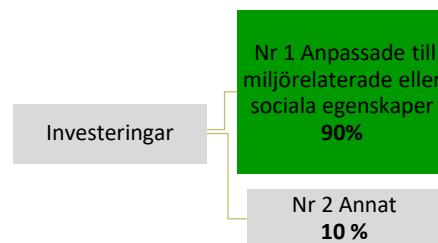
Fonden väljer bort vissa produkter och tjänster som bedöms löpa stor risk att ha negativa effekter på omvärlden och som är oförenliga med förvaltarens roll som ansvarsfull investerare. Fonden väljer också aktivt in bolag som bedriver sin verksamhet på ett hållbart sätt eller vars produkter och tjänster bidrar till en hållbar utveckling.

Fonden exkluderar även bolag som är listade på NBIMs exkluderingslista (Norges Bank Investment Management).

Hållbarhetskraven innebär att potentiella investeringar för fonden har exkluderats.

*Genom att välja bort bolag som bryter mot internationella normer och konventioner kopplade till exempelvis skatt, arbetstagarnas rättigheter samt korruption och mutor tillses att de bolag fonden placerar i lever upp till grundläggande krav vad avser god bolagsstyrning.*

### Andel av investeringar



Fonden är en aktiefond som via investeringar i överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument tar exponering mot europeiska aktier. Fonden är att betrakta som en bred aktiefond som allokerar mellan olika typer av sektorer och storlek på bolag. Fondens målsättning är att över tid generera en genomsnittlig årlig avkastning som överstiger indexet MSCI Europe ESG Universal Index. Förvaltningen av fonden syftar till att främja bland annat miljörelaterade eller sociala egenskaper, eller en kombination av dessa egenskaper. Fonden investerar i likvida aktier handlade på de största europeiska marknaderna och uppnår därigenom en portfölj bestående av likvida aktier i bolag med hög rapporteringsstandard.

EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Enligt regelverket ska det för varje fond redovisas hur stor del av fondens investeringar som är förenliga med taxonomin. De bolag som fonden investerar i har ännu inte börjat rapportera i vilken utsträckning som deras verksamhet är förenlig med EU-taxonomin. Därför bedömer fondbolaget att det i dagsläget inte är möjligt att lämna tillförlitliga uppgifter om hur stor andel av fondens investeringar som är förenliga med taxonomin och redovisar mot angiven bakgrund att 0% av fondens investeringar är förenliga med EU-taxonomin.

### Övervakning av miljörelaterade eller sociala egenskaper

Fondbolaget övervakar löpande att de miljörelaterade/sociala egenskaper fonden främjar efterlevs. Det sker genom kontroll av att fonden följer sina bestämmelser om exkludering av bolag. Kontrollen avser branscher som

## Hållbarhetsrelaterade upplysningar NorQuant ESG

väljs bort och som förvaltaren anser riskerar att motverka en hållbar utveckling. Fondbolaget följer även upp att bolagen som fonden investerar i inte bryter mot internationella normer och konventioner. För ytterligare information se nedan under rubriken "Metoder"

Följande hållbarhetsindikatorer används för att bedöma de miljörelaterade/sociala egenskaperna hos fonden:

- Intäkter från verksamhet avseende produktion och distribution av förbjudna vapen, kärnvapen, vapen och krigsmateriel, alkohol, tobak, cannabis, pornografi, kommersiell spelverksamhet och fossila bränslen.
- Bolag som är listade på NBIM:s exkluderingslista
- Växthusgasintensitet mätt som växthusgasutsläpp enligt Scope 1, 2 och 3.
- Bolag som bryter mot internationella normer och konventioner relaterade till mänskliga rättigheter, miljö, arbetsrätt eller bekämpning av korruption och mutor.

### Metoder

Fonden tillämpar löpande uppföljning på innehavsnivå för att säkerställa att bolag med verksamhet i av fonden exkluderade sektorer och/eller bolag som bryter mot internationella normer och konventioner inte återfinns i fonden. Det innebär att information om varje enskilt bolag i fonden hämtas direkt från dataleverantören Datia. (Datia | The Data Platform for Sustainable Finance). Vid förändrad bedömning av ett bolag flaggas det i fondens löpande uppföljning, informationen valideras av förvaltaren och bolaget exkluderas ur fonden givet korrekt information.

### Datakällor och behandling

Information om bolagens exponering mot exkluderade verksamheter och incidenter som föranleder brott mot internationella normer och konventioner inhämtas från dataleverantören Datia | The Data Platform for Sustainable Finance. Dataleverantören inhämtar information om bolagens exponering mot exkluderade verksamheter från publika presentationer utgivna av bolagen och/eller via direktkontakt med bolagen. Information om brott mot internationella normer och konventioner hämtas från media, intresseorganisationer och via direktkontakt med bolagen. Fondbolagets riskkontroll tar emot datan och utför den löpande kontrollen av fonden. Andelen av datan som är estimerad följs inte upp i dagsläget.

Fondbolaget genomför löpande diskussioner med dataleverantörerna, för att säkerställa god datakvalitet. Särskild analys görs vid bolagsfall där det finns motstridig information. Vid tveksamma situationer kontaktas bolaget i fråga för att ha möjlighet att ge sin syn.

### Begränsningar för metoder och data

Informationen om portföljbolagens exponering mot exkluderade verksamheter är begränsad till information som görs tillgänglig från portföljbolagen själva. Det innebär att det inte alltid går att säkerställa den exakta exponeringen mot dessa verksamheter. Detta förhållande bedöms dock ha en begränsad inverkan på utfallet och bedöms som acceptabel.

### Due diligence

Förvaltaren har due diligence rutiner på plats för att säkerställa att hållbarhetsrisker samt de hållbarhetskrav som uppställts för fonden beaktas i investeringsbesluten.

Hållbarhetsanalys integreras i den bolagsanalys som ligger till grund för de förvaltningsbeslut som fattas. Fonden investerar i noterade aktier inom EES (Europeiska ekonomiska samarbetsområdet). Det datadrivna aktieurvalet och portföljens sammansättning är regelbaserat, och har en integrerad faktorbaserad strategi. Huvudfaktorn i aktievalet baseras på ESG-poäng utifrån FN:s tio Global Compact principer som hämtas från ansedda leverantörer. Dessa poäng kombineras sedan med andra stilfaktorer (som momentum och low volatility) för att sätta ihop en optimerad portfölj med målsättningen att över tid generera en genomsnittlig årlig avkastning som överstiger indexet MSCI Europe ESG Universal Index.

Utöver denna process tillämpas exkluderingsstrategier i fonden.

### **Strategier för engagemang (aktieägarengagemang)**

Förvaltaren har inga strategier för aktieägarengagemang utan använder sig av strategierna att inkludera innehav eller att exkludera innehav.

### **Valt referensvärde**

MSCI Europe ESG Universal Index är baserat på MSCI Europe Index (dess moderindex) och inkluderar stora och medelstora företag i över 15 utvecklade marknader (DM) i Europa. Indexet är utformat för att återspegla resultatet av en investeringsstrategi som, genom att styra bort från fritt flytande marknadsvikter, försöker få exponering mot de företag som visar både en robust ESG-profil samt en positiv trend för att förbättra den profilen med minimala undantag från MSCI Europe-indexet.