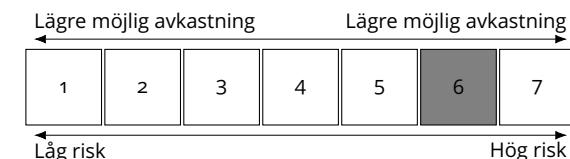


## Information om fonden

NorQuant ESG är en diversifierad, hållbar aktiefond. Fonden har ett regelbaserat, kvantitativt tillvägagångssätt och investerar i en portfölj bestående av 100 noterade europeiska aktier. NorQuant ESG har som mål att ge en långsiktig överavkastning jämfört med MSCI Europe ESG. Allokeringen i Fondens bestäms utifrån en regelbaserad, kvantitativ modell som sätter samman en portfölj spridd över 100 noterade europeiska aktier med en hållbar profil, med den högsta förväntade riskjusterade avkastningen baserat på NorQuants faktorbaserade modeller. Fonden investerar inte i derivat och tar inga korta positioner. Fonden kan ha en betydande vikt mot olika sektorer eller länder. Fonden investerar i europeiska aktier och har alltså en valutarisk. NorQuant ESG är en aktiefond med UCITS-status.

## Riskprofil



**Risk/avkastningsindikatorn** visar sambandet mellan risk och möjlig avkastning för dig som investerar i Fonden. Riskkategoriseringen baseras på simulerade och/eller historiska portföljdata och beskriver priskänsligheten för fondens positioner under de senaste fem åren.

**Fonden tillhör kategori 6**, vilket innebär stor chans/risk för upp- eller nedgångar i andelsvärdet.

## Marknadskommentar



NorQuant ESG sjönk med 0.1 procent i december, vilket var 0.7 procentenheter bättre än fondens jämförelseindex. Euron stärktes med 2 procent mot den svenska kronan vilket hade en positiv påverkan på avkastningen. Sedan starten av fonden för 18 månader sedan har fonden gett en avkastning på -1.7 procent, vilket är svagare än jämförelseindex som under samma period har haft en värdeutveckling på +7.6 procent. Fonden är fortsatt tungt viktad mot europeiska aktier utanför euroområdet, särskilt skandinaviska aktier.

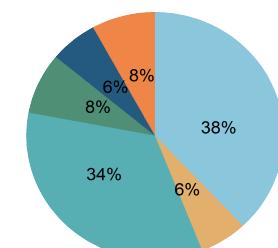
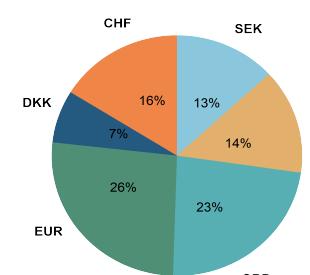
## Fondavkastning sedan start



Fond/index	Avkastning sedan start	Avkastning månaden	YTD	Årlig Volatilitet
NorQuant ESG D*	-1.7 %	-0.1 %	-8.7 %	14.3 %
MSCI Europe ESG (SEK)	7.6 %	-0.8 %	-3.1 %	16.2 %

\*Avkastning efter kostnader

## Valuta och sektorexponering



- Commercial Services
- Communications
- Consumer Non-Durables
- Finance
- Industrial Services
- Other

## Disclaimer

NorQuant Kapitalförvaltning AS (med organisationsnummer 822 651 992) är ett värdedepappersföretag med tillstånd från Finansinspektionen i Norge. Informationen ska inte tolkas som råd eller rekommendationer om köp eller försäljning av finansiella instrument eller värdedepapper. Bolaget tar inte ansvar för handlingar som utförs utifrån informationen på dessa sidor. Alla investeringar innebär en risk och sådana beslut fattas självständigt och på egen risk. Informationen på dessa sidor bör inte användas i stället för den professionella rådgivning individueller eller företag kan behöva, och företaget kan inte garantera att informationen är korrekt eller fullständig.