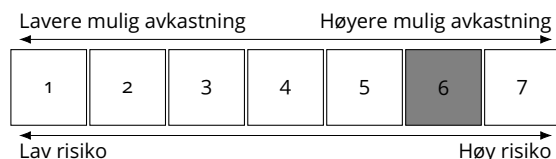


Informasjon om fondet

NorQuant ESG er et diversifisert, bærekraftig aksjefond. Fondet har en regelstyrt, kvantitativ tilnærming og investerer i en portefølje bestående av 100 børsnoterte europeiske aksjer. NorQuant ESG har som mål å gi en langsiktig meravkastning sammenlignet med referanseindeksen MSCI Europe ESG Universal. Allokeringen i fondet bestemmes ut ifra en regelstyrt, kvantitativ modell som setter sammen en portefølje fordelt på 100 børsnoterte europeiske aksjer med en bærekraftig profil, med høyest forventet risikojustert avkastning basert på NorQuants faktorbaserte modeller. Fondet er «long only», og investerer ikke i derivater. Fondet kan ha en betydelig vektning mot forskjellige sektorer eller land. Fondet investerer i europeiske aksjer og har dermed en valutarisiko. NorQuant ESG er et aksjefond med UCITS-status.

Risikoprofil



Risiko/avkastningsindikatoren viser forholdet mellom risiko og mulig avkastning når du investerer i andelsklassen. Risikokategorien for andelsklassen er basert på simulert og/eller historisk porteføljedata og beskriver prissensitiviteten til Fondets posisjoner over de siste fem år.

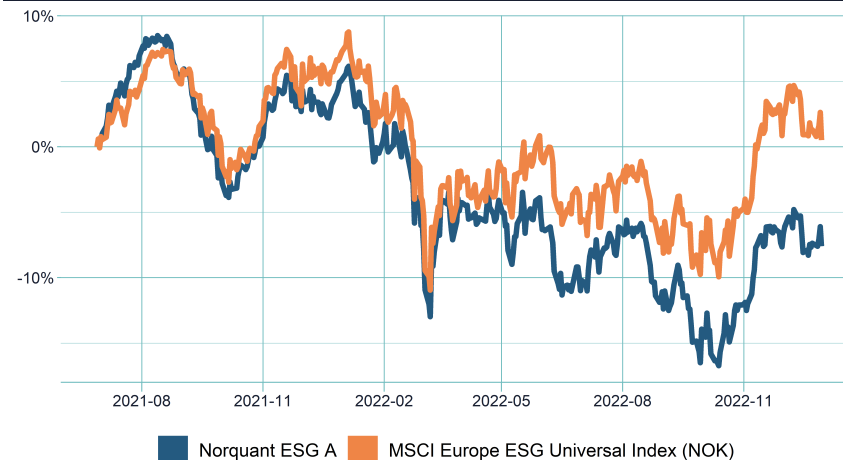
Fondet tilhører kategori 6, som betyr høy sjans/risiko for opp eller nedganger i andelsverdien.

Markedskommentar



NorQuant ESG steg 0.1 % i desember. Dette er 0.4% bedre enn referanseindeksen som falt 0.3 %. Euroen styrket seg nesten 2.5% mot norske kroner i desember. Dette påvirket avkastningen positivt. Siden oppstart av fondet for ca. 18 måneder siden har NorQuant ESG gitt en avkastning på -7.6 %. Dette er 8.1 % svakere enn referanseindeksen som har vist en utvikling på 0.5 %. Fondet har hatt en noe lavere volatilitet enn referanseindeksen. NorQuant ESG er fortsatt sterkt vektet mot europeiske aksjer utenfor Euro-området, særlig skandinaviske aksjer, som generelt ligger i verdenstoppen på ESG-kriterier og hvor vi også finner mange aksjer som scorer høyt på de øvrige kvantitative faktorene som vår strategi vurderer.

Fondsavkastning siden start



Fond / Indeks	Avkastning Siden start	Avkastning Siste måned	YTD	Årlig Volatilitet
NorQuant ESG A*	-7.6 %	0.1 %	-12.0 %	15.2 %
MSCI Europe ESG (NOK)	0.5 %	-0.3 %	-6.3 %	17.8 %

*Avkastning etter kostnader

Valuta og sektoreksponering

