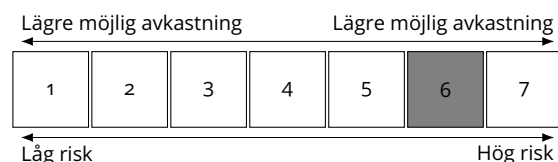


Information om fonden

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 Fonden 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 2,4% i januari, vilket var i linje med fondens jämförelseindex. Börserna i Europa hade en svag månad. En stark euro (ca +2%) bidrog positivt till vårt resultat mätt i svenska kronor. Sedan fondstarten för sju månader sedan har NorQuant ESG gett en avkastning på +5,1%. Det är 3,2 % mindre än jämförelseindexet, som har stigit med 8,3 %, men till en lägre volatilitet. NorQuant ESG är fortfarande relativt tungt viktat mot europeiska aktier utanför euroområdet, särskilt skandinaviska aktier, som generellt ligger i världstoppen på ESG-kriterier och där vi nu även hittar många aktier som får höga poäng på de andra kvantitativa faktorerna som vår strategi fokuserar på.

Fondavkastning sedan start



Fond/index	Avkastning sedan start	Avkastning månaden	Årlig Volatilitet
NorQuant ESG D*	5.1 %	-2.4 %	11.4 %
MSCI Europe ESG (SEK)	8.3 %	-2.4 %	13.2 %

*Avkastning efter kostnader

Valuta och sektorexponering

