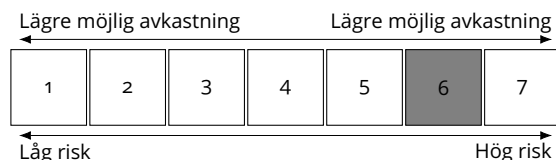


Information om fonden

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.

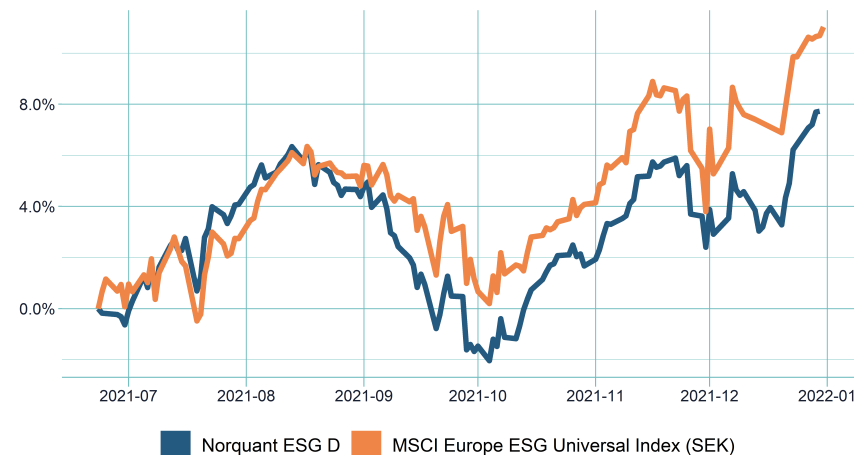
**Fonden tillhör kategori 6**, vilket innebär stor chans/risk för upp- eller nedgångar i andelsvärdet.

Marknadskommentar



NorQuant ESG steg med 5,2% i december, vilket var 1,8% lägre än jämförelseindex. Börserna i Europa visade en stark avkastning. Sedan starten av fonden för drygt ett halvår sedan har NorQuant ESG gett en avkastning på +7,7%, vilket är 3,3% mindre än jämförelseindex som har stigit med 11%, men med betydligt lägre volatilitet. NorQuant ESG är fortfarande relativt starkt viktat mot europeiska aktier utanför euroområdet, i synnerhet skandinaviska aktier, som generellt ligger i världstoppen i ESG-kriterier och där vi nu också hittar många aktier som kommer högt upp på andra kvantitativa faktorer som vår strategi tar hänsyn till.

Fondavkastning sedan start



Fond/index	Avkastning sedan start	Avkastning månaden	Årlig Volatilitet
NorQuant ESG D*	7.7 %	5.2 %	10.2 %
MSCI Europe ESG (SEK)	11.0 %	7.0 %	12.2 %

\*Avkastning efter kostnader

Valuta och sektorexponering

