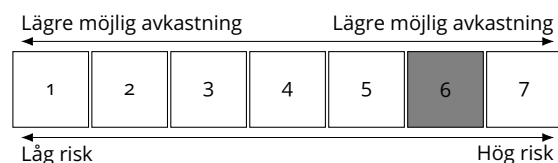


Information om fonden

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



Fonden sjönk med 1,9 % under månaden, vilket var något svagare än jämförelseindex. Börserna i Europa hade en svag månad men en svagare krona dämpade fondens nedgång. Sedan starten för åtta månader sedan har NorQuant ESG gett en avkastning på +3,1 %, vilket är 3,5 % sämre än jämförelseindex, dock till en lägre volatilitet än index. Fonden 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*	3.1 %	-1.9 %	12.6 %
MSCI Europe ESG (SEK)	6.6 %	-1.6 %	15.0 %

*Avkastning efter kostnader

Valuta och sektorexponering

