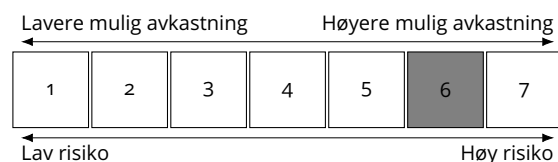


Informasjon om fondet

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 risikjustert 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 1,2% i desember, noe som var 1,6% mindre enn referanseindeksen. Aksjemarkedene i Europa viste en sterk avkastning, men en sterk krone førte til en lavere avkastning målt i norske kroner. Siden oppstart av fondet for litt over et halvt år siden har NorQuant ESG gitt en avkastning på +5,0%, noe som er 2% mindre enn referanseindeksen som har steget 7%, men med betydelig lavere volatilitet. NorQuant ESG er fortsatt relativt sterkt vektet mot europeiske aksjer utenfor Euro-området, særlig skandinaviske aksjer, som generelt ligger i verdenstoppen på ESG-kriterier og hvor vi nå også finner mange aksjer som scorer høyt på de øvrige kvantitative faktorene som vår strategi vurderer.

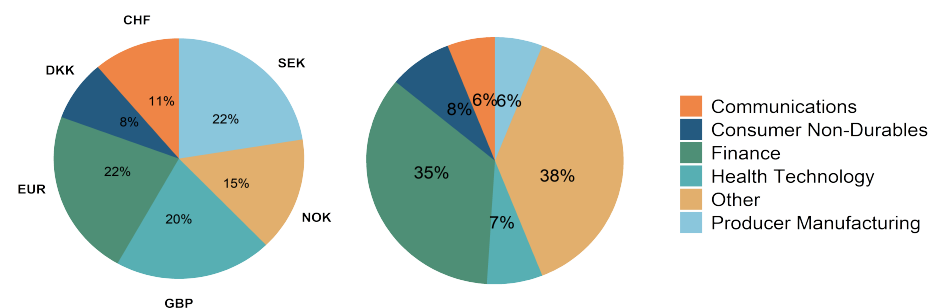
Fondsavkastning siden start



Fond / Indeks	Avkastning Siden start	Avkastning Siste måned	Årlig Volatilitet
NorQuant ESG*	5.0 %	2.2 %	9.7 %
MSCI Europe ESG (NOK)	7.0 %	3.8 %	12.0 %
OSEBX	6.4 %	1.7 %	13.8 %

*Avkastning etter kostnader

Valuta og sektoreksponering



Disclaimer

NorQuant Kapitalforvaltning AS (org.nr. 822 651 992) er et verdipapirforetak med konsesjon fra Finanstilsynet. Informasjonen er ikke å betrakte som råd eller anbefalinger om kjøp eller salg av finansielle instrumenter eller verdipapirer. Selskapet påtar seg ikke ansvar for handlinger utført på bakgrunn av informasjon på disse sidene. Alle investeringer innebærer risiko, og slike beslutninger tas selvstendig og på eget ansvar. Informasjonen på disse sidene skal ikke brukes istedenfor den profesjonelle rådgivningen enkeltpersoner eller bedrifter kan ha behov for, og selskapet kan ikke garantere for at informasjonen er presis eller fullstendig.