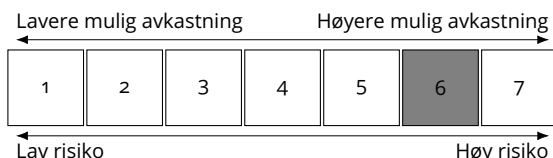


Informasjon om fondet

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.

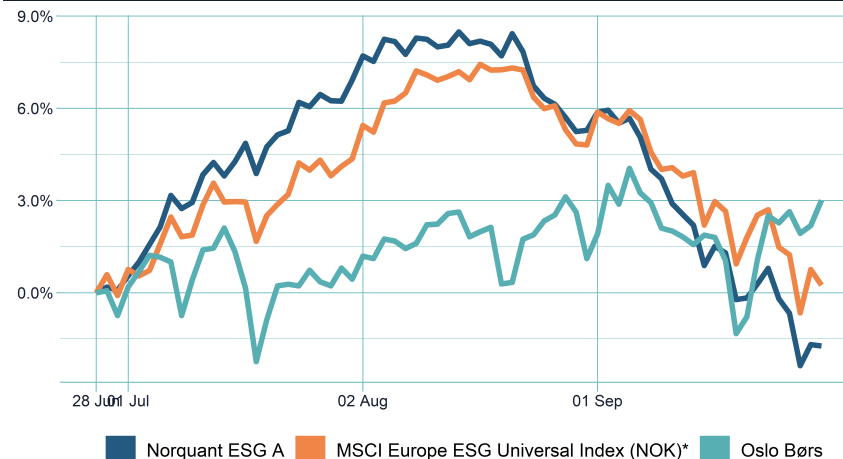
Markedskommentar



NorQuant ESG viste en negativ avkastning på -6,7 % i september, mens referanseindeksen falt 4,3 %. Mindreavkastningen for måneden ble dermed på 2,4 %. Fallet var mest drevet av negative aksjemarkeder i Europa, men også en svak euro og en mindreavkastning for aksjene i porteføljen bidro til det negative resultatet for måneden. Siden oppstart viser NorQuant ESG fortsatt en svak mindreavkastning på -1,9 %. NorQuant ESG består av en portefølje på 100 europeiske aksjer. Fondet er per dags dato relativt sterkt vektet mot de skandinaviske aksjemarkedene, som generelt ligger i verdenstoppen av ESG-kriteria, og hvor vi nå også finner mange aksjer som scorer høyt på de øvrige kvantitative faktorene som vår strategi vurderer.

Thomas Nygaard

Fondsavkastning siden start



Fond / Indeks	Siden start	Siste måned
NorQuant ESG	-1.7 %	-6.7 %
MSCI Europe ESG (NOK)	+0.2 %	-4.3 %
OSEBX	+3.0 %	+1.9 %

Avkastning etter kostnader

Sektor og valuta eksponering

