

Storebrand Global Multifactor A



Morningstar Kategori™

Globale, Små-/ mellomstore selskaper

Morningstar sin referanseindeks

MSCI ACWI NR

Benyttet i hele rapporten

Fondets referanseindeks

MSCI World NR USD

Morningstar Rating™

★★★★

Investeringsprofil

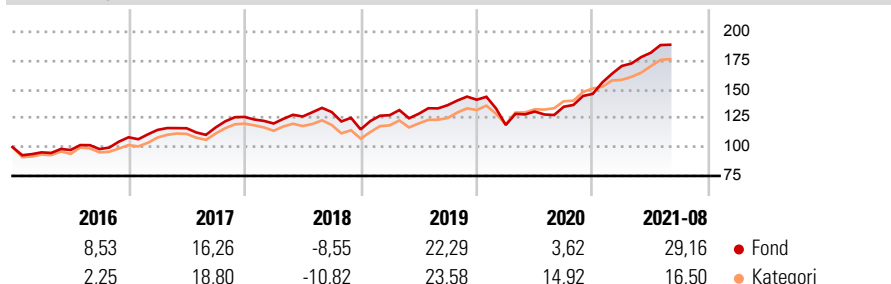
Storebrand Global Multifactor har som mål å oppnå langsiktig meravkastning ved å investere i globale, velutviklede aksjemarkeder. Fondet er et modellbasert faktorfond, som søker å utnytte veldokumenterte risikopremier knyttet til faktorene; verdi, størrelse, momentum og lav volatilitet. Porteføljen er sektor- og regionsnøytral, likevektet på faktornivå, og vil normalt bestå av 300-400 store og mellomstore aksjeselskaper. Fondet forvaltes i tråd med Storebrands prinsipper for bærekraftige investeringer. Fondet har UCITS-status, og referanseindeksen er MSCI World NTR.

Risikomål

3 år Alpha	-4,60	3 år Sharpe Ratio	0,79
3 år Beta	1,14	3 år standardavvik	14,85
3 år R2	91,05	3 års risiko	Gj.sn
3 år Info Ratio	-0,54	5 års risiko	Gj.sn
3 år Tracking Error	6,95	10 års risiko	Gj.sn

Beregningen bruker MSCI ACWI NR (hvor indeks kreves)

Avkastning



Løpende avk. %

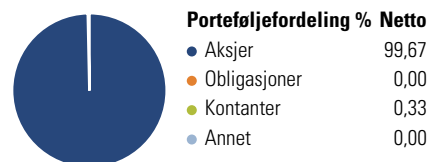
Løpende avk. %	Fond	Kategori
3 måneder	1,50	1,52
6 måneder	6,23	7,76
1 år	37,13	24,14
3 år ann.	11,47	13,04
5 år ann.	12,40	12,98
10 år ann.	16,82	14,40

Dato 21.09.2021

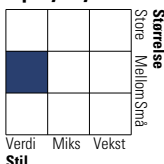
Kvartalsvis avkastning %

Kvartalsvis avkastning %	Q1	Q2	Q3	Q4
2021	16,54	6,75	-	-
2020	-15,54	9,79	3,21	8,27
2019	10,67	0,94	5,83	3,44
2018	-4,50	5,04	3,07	-11,55
2017	5,93	1,21	0,61	7,78

Portefølje 31.08.2021



Equity Style Box™

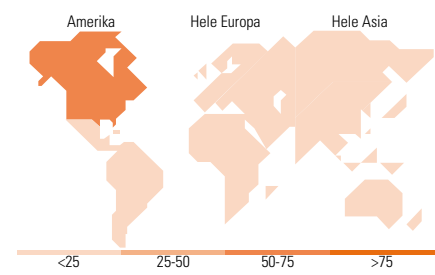


Markedsverdi %

Markedsverdi %	Fond
Gigant	5,75
Store	32,35
Middels	51,59
Små	9,81
Mikro	0,50

Markedsverdi NOK

Markedsverdi NOK	Fond
Gj.snitt markedsverdi	138 246,
NOK	85



Største plasseringer

Beholdning	Sektor	%
Danaher Corp	+	1,19
Republic Services Inc	+	1,06
Waste Management Inc	+	1,03
Swisscom AG	+	1,02
Broadridge Financial...	+	1,00
BCE Inc	+	0,96
NN Group NV	+	0,95
Waste Connections Inc	+	0,94
EPAM Systems Inc	+	0,94
United Therapeutics Corp	+	0,89
% av investeringer i fondets 10 største plasseringer		9,98
Totalt antall aksjer		324
Totalt antall renteinstrumenter		0

Sektorfordeling %

Sektorfordeling %	Fond
Syklisk	33,25
Materialer	4,38
Konsumentvarer	11,61
Finans	13,37
Eiendom	3,88
Sensitiv	44,28
Kommunikasjon	8,96
Olje & Gass	2,96
Industri	11,52
Teknologi	20,84
Defensiv	22,48
Forbruksvarer	7,66
Helsevern	11,95
Forsyning	2,87

Regionfordeling %

Regionfordeling %	Fond
Amerika	69,04
USA	59,41
Canada	9,44
Latin-Amerika	0,19
Europa	18,86
Storbritannia	1,36
Eurosonen	10,42
Europa - eks. euro	5,81
Europa - Vekstmarkeder	0,00
Afrika	0,00
Midt-Østen	1,27
Asia	12,10
Japan	7,78
Australasia	0,97
Asia - Utviklede markeder	2,57
Asia - Vekstmarkeder	0,79

Fondfakta

Forvalter	Storebrand Asset Management AS	Andelskl. kapital(m)	18 720,77 NOK	Minsteinnskudd	- NOK
Fondets startdato	19.12.2006	(31.08.2021)		Minste sparebeløp	- NOK
Navn på forvalter	Andreas Poole	Domisil	Norge	Kjøpsavgift	-
Forvaltet fondet siden	01.11.2011	Valuta	NOK	Salgsavgift	-
NAV/Kurs (21.09.2021)	NOK 3 245,15	UCITS	Ja	Forvaltningsavgift	0,75%
Forv.kap. (mill.) (31.08.2021)	19 244,56 NOK	Inc eller Acc	Acc		
		ISIN	N00010346422		