

Storebrand Glb Multifaktor Valutsikr. A



Morningstar Kategori™

Bransjefond, Øvrige

Morningstar sin referanseindeks

Ikke kategorisert
Benyttet i hele rapporten

Fondets referanseindeks

MSCI World Net Hdg NOK

Morningstar Rating™

Ikke vurdert

Investeringsprofil

Storebrand Global Multifaktor Valutasikret er et aksjefond som har som mål å oppnå langsiktig meravkastning ved å investere i globale, velutviklede aksjemarkeder. Fondet investerer i underfondet Storebrand Global Multifaktor som 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 inneholder normalt 300-400 store og mellomstore selskaper fra referanseindeksen. Fondet har UCITS-status, og referanseindeks er MSCI World NR valutasikret til norske kroner. Fondet blir i all hovedsak valutasikret til norske kroner. Fondet forvaltes i tråd med Storebrands prinsipper for bærekraftige investeringer. For mer informasjon, se fondets prospekt.

Risikomål

3 år Alpha	-	3 år Sharpe Ratio	0,40
3 år Beta	-	3 år standardavvik	14,24
3 år R2	-	3 års risiko	-
3 år Info Ratio	-	5 års risiko	-
3 år Tracking Error	-	10 års risiko	-

Avkastning



Løpende avk. %

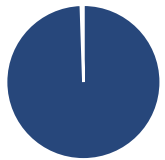
Løpende avk. %	Fond
3 måneder	5,48
6 måneder	19,72
1 år	19,40
3 år ann.	4,95
5 år ann.	7,75
10 år ann.	-

Dato 26.04.2024

Kvartalsvis avkastning %

Kvartalsvis avkastning %	Q1	Q2	Q3	Q4
2024	9,65	-	-	-
2023	3,43	4,46	-1,59	7,29
2022	-5,53	-10,46	-5,04	8,83
2021	17,97	5,70	-0,57	6,97
2020	-31,29	18,23	4,74	15,42

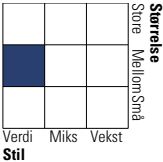
Portefølje 31.03.2024



Porteføljefordeling % Netto

Aksjer	99,47
Obligasjoner	0,00
Kontanter	0,48
Annet	0,05

Equity Style Box™

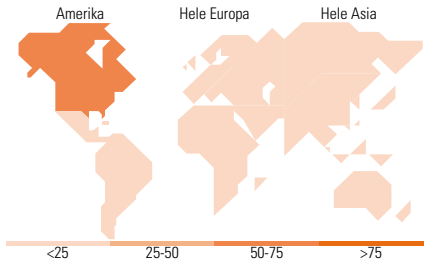


Markedsverdi %

Markedsverdi %	Fond
Gigant	3,74
Store	31,23
Middels	50,22
Små	12,04
Mikro	2,77

Markedsverdi NOK

Markedsverdi NOK	Fond
Gj.snitt markedsverdi NOK	185 890,35



Største plasseringer

Beholdning	Sektor	%
Dell Technologies Inc...	IT	1,40
PulteGroup Inc	Bygging	1,19
Waste Connections Inc	Utskrottsforvaltning	1,15
Cencora Inc	Utskrottsforvaltning	1,13
Republic Services Inc	Utskrottsforvaltning	1,12
Waste Management Inc	Utskrottsforvaltning	1,08
D.R. Horton Inc	Bygging	1,06
Check Point Software...	IT	1,05
Colgate-Palmolive Co	Forbruker	1,04
Kimberly-Clark Corp	Forbruker	0,99
% av investeringer i fondets 10 største plasseringer		11,20
Totalt antall aksjer		0
Totalt antall renteinstrumenter		0

Sektorfordeling %

Sektorfordeling %	Fond
Syklisk	30,66
Materialer	2,87
Konsumentvarer	11,76
Finans	13,09
Eiendom	2,94
Sensitiv	48,86
Kommunikasjon	6,93
Olje & Gass	4,29
Industri	13,25
Teknologi	24,39
Defensiv	20,48
Forbruksvarer	5,98
Helsevern	11,95
Forsyning	2,55

Regionfordeling %

Regionfordeling %	Fond
Amerika	72,20
USA	62,36
Canada	8,84
Latin-Amerika	1,00
Europa	17,91
Storbritannia	2,00
Eurosonen	10,35
Europa - eks. euro	4,15
Europa - Vekstmarkeder	0,00
Afrika	0,00
Midt-Østen	1,41
Asia	9,89
Japan	8,48
Australasia	0,59
Asia - Utviklede markeder	0,61
Asia - Vekstmarkeder	0,20

Fondfakta

Forvalter	Storebrand Asset Management AS	Andelskl. kapital(m)	144,84 NOK	Minsteinnskudd	- NOK
Fondets startdato	29.03.2017	Domisil	Norge	Minste sparebeløp	- NOK
Navn på forvalter	Andreas Poole	Valuta	NOK	Kjøpsavgift	-
Forvaltet fondet siden	29.03.2017	UCITS	Ja	Salgsavgift	-
NAV/Kurs (26.04.2024)	NOK 1 608,25	Inc eller Acc	Acc	Forvaltningsavgift	0,77%
Forv.kap. (mill.) (31.03.2024)	897,53 NOK	ISIN	N00010776354		