

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

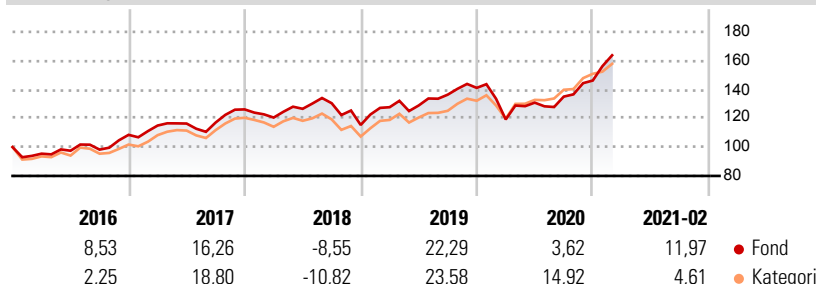
Storebrand Global Multifactor har som mål å oppnå langsiktig meravkastning ved å investere i globale, velutviklede aksjemarkeder. Fondet er et modellbasert faktorfond, som søker å utnytte veldokumenterte risikopremier knyttet til faktorene; verdi, størrelse, momentum og lav volatilitet. Porteføljen er 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	-3,80	3 år Sharpe Ratio	0,66
3 år Beta	1,14	3 år standardavvik	14,91
3 år R2	91,76	3 års risiko	Gj.sn
3 år Info Ratio	-0,51	5 års risiko	Gj.sn
3 år Tracking Error	6,60	10 års risiko	Gj.sn

Beregningen bruker MSCI ACWI NR (hvor indeks kreves)

Avkastning



Løpende avk. %

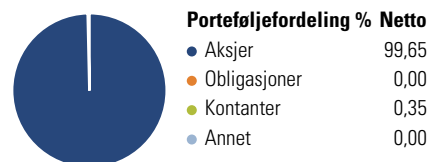
Løpende avk. %	Fond	Kategori
3 måneder	14,27	5,35
6 måneder	24,33	13,70
1 år	41,25	38,21
3 år ann.	12,56	12,45
5 år ann.	11,66	11,51
10 år ann.	14,09	12,01

Dato 24.03.2021

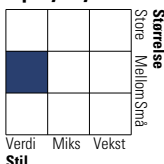
Kvartalsvis avkastning %

Kvartalsvis avkastning %	Q1	Q2	Q3	Q4
2021	-	-	-	-
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 28.02.2021



Equity Style Box™

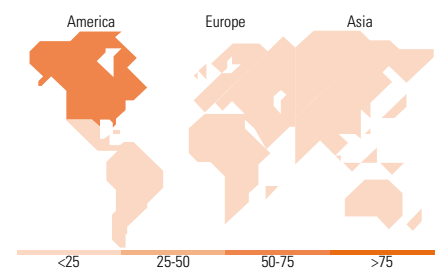


Markedsverdi %

Markedsverdi %	Fond
Gigant	3,37
Store	35,42
Middels	49,12
Små	10,36
Mikro	1,73

Markedsverdi NOK

Markedsverdi NOK	Fond
Gj.snitt markedsverdi	117 232,
NOK	68



Største plasseringer

Beholdning	Sektor	%
ViacomCBS Inc Class B	Media	1,84
Stellantis NV	Industri	1,67
Magna International Inc...	Industri	1,39
Discovery Inc Class A	Media	1,37
Danaher Corp	Industri	1,16
Aegon NV	Finans	1,13
Swisscom AG	Telekom	1,00
Zebra Technologies Corp	Industri	0,96
United Therapeutics Corp	Industri	0,94
Waste Connections Inc	Industri	0,93
% av investeringer i fondets 10 største plasseringer		12,40
Totalt antall aksjer		283
Totalt antall renteinstrumenter		0

Sektorfordeling %

Sektorfordeling %	Fond
Syklisk	33,61
Materialer	3,89
Konsumentvarer	13,63
Finans	11,84
Eiendom	4,25
Sensitiv	44,22
Kommunikasjon	9,24
Olje & Gass	2,97
Industri	10,75
Teknologi	21,26
Defensiv	22,17
Forbruksvarer	7,35
Helsevern	12,04
Forsyning	2,79

Regionfordeling %

Regionfordeling %	Fond
Amerika	65,91
USA	56,25
Canada	9,66
Latin-Amerika	0,00
Europa	20,88
Storbritannia	2,11
Eurosonen	10,96
Europa - eks. euro	6,00
Europa - Vekstmarkeder	0,00
Afrika	0,00
Midt-Østen	1,80
Asia	13,21
Japan	8,40
Australasia	1,20
Asia - Utviklede markeder	2,87
Asia - Vekstmarkeder	0,74

Fondfakta

Forvalter	Storebrand Asset Management AS	Andelskl. kapital(m)	12 824,36 NOK	Minsteinnskudd	- NOK
Fondets startdato	19.12.2006	(28.02.2021)		Minste sparebeløp	- NOK
Navn på forvalter	Andreas Poole	Domisil	Norge	Kjøpsavgift	-
Forvaltet fondet siden	01.11.2011	Valuta	NOK	Salgsavgift	-
NAV/Kurs (24.03.2021)	NOK 2 977,93	UCITS	Ja	Forvaltningsavgift	0,75%
Forv.kap. (mill.) (28.02.2021)	13 236,38 NOK	Inc eller Acc	Acc		
		ISIN	N00010346422		