

Fakta om fonden

ISIN: NO0010841596

Lanceringsdato, andelsklasse:
26.02.2019

Lanceringsdato, fond: 19.12.2006

Andelsklasse valuta: DKK

NAV: 1.689,94 DKK

AUM: 17.079 MDKK

Referenceindeks: MSCI World
(NDDUWI Index)

Minimumsinvestering: 100 DKK

Fast forvaltningshonorar: 0,75 %

Løbende omkostninger: 0,75 %

Antal værdipapirer: 354

SFDR: Artikel 8



Andreas Poole
Forvaltet fonden siden
01. november 2011

Investeringsstrategi

Storebrand Global Multifactor er en aktiefond, som har til formål at opnå et langsigtet merafkast ved at investere i globale, udviklede aktiemarkeder. Fonden er en modelbaseret faktorfond, som søger at udnytte veldokumenterede risikopræmier knyttet til følgende faktorer: Værdi, Størrelse, Momentum og Lav-volatilitet. Porteføljen er sektor- og regionsneutral, ligevægtet på faktorniveau og indeholder normalt 300-400 store og mellemstore selskaber fra referenceindekset. Derivater kan benyttes for at opnå en mere rimelig eller effektiv forvaltning. Fonden forvaltes i tråd med Storebrands principper for bæredygtige investeringer.

Storebrand Global Multifactor A (DKK)

BÆREDYGTIGHED



RISIKOPROFIL



ÅR-TIL-DATO AFKAST

10,71 %
27.03.2024

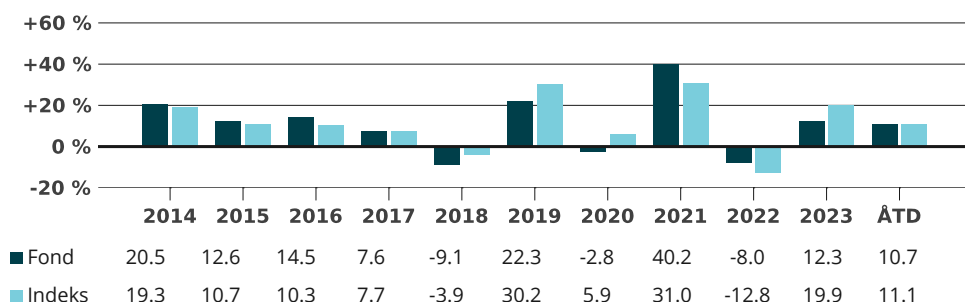
ÅRLIG AFKAST

11,26 %
Gennemsnitligt sidste 5 år

Månedrapport for Marts 31.03.2024. Alle opgørelser er i DKK medmindre andet er angivet.

Historisk afkast er ingen garanti for fremtidige afkast. Fremtidige afkast vil afhænge af markedsudviklingen, porteføljeforvalterens evner, fondens risikoprofil samt tilhørende omkostninger. Afkastet kan blive negativt som følge af en negativ prisudvikling. Fondens centrale investorinformation samt faktaark er tilgængeligt på hjemmesiden: storebrandfondene.dk

Historisk afkast i DKK



Benchmark-indekset kan bruges som referencepunkt til at sammenligne afkastet af fonden. Indekset kan også være en kilde til valg af fondens investeringer, men fondens sammensætning kan afvige væsentligt fra indekset.

Tidligere udvikling inden startdatoen for aktieklassen refererer til en anden aktieklasse, som er repræsentativ for denne udvikling.

Periode	Fond (%)	Indeks (%)	Nøgletal	1 år	2 år	3 år
Sidste måned	4,61	3,21	Std.afvigelse	-	-	12,74
År-til-dato	10,71	11,13	Std.afvigelse indeks	-	-	13,95
12 måneder	24,64	28,90	Tracking error	-	-	4,76
3 år (årlig)	9,70	11,82	Information ratio	-	-	-0,44
5 år (årlig)	11,26	13,05	Active share: 91 %			
10 år (årlig)	11,10	12,15				
Siden start (årlig)	6,88	8,27				

Forvalterkommentar for marts 2024

I marts havde fonden en værdiopgang på 4,61 pct., mens referenceindekset steg med 3,21 pct. I indeværende år er fonden oppe med 10,71 pct.

Fonden sigter mod at opnå et merafkast gennem høstning af risikopræmier. Disse er: Verdi, Momentum, Size og Lav-volatilitet, som alle historisk set har givet et merafkast (Verdi, Momentum, Size) eller et højere risikojusteret afkast (Lav-vol) i forhold til markedet. Hver præmie er vægtet med 25 procent i porteføljen. I lokal valuta var fondens afkast 1,5 procentpoint bedre end indekset før omkostninger. Value var 4 procentpoint bedre end indekset, Size var 0,8 procentpoint dårligere end indekset, Momentum var 2 procentpoint bedre end indekset, mens Lav-vol var 1 procentpoint bedre end indekset.

Globale aktier målt ved MSCI World i lokal valuta steg med yderligere 3 pct. i marts, hvilket betyder, at opgangen i indeværende år har været på over 10 pct. Fortsat gode makrotal og yderligere bedring i væksteudsigterne i specielt USA kombineret med dueagtige centralbanker har bidraget til yderligere opgang i aktierne. Sentimentet for globale aktier er fortsat optimistisk. Dette kan gøre markederne mere sårbare for skuffelser, samt korrektioner, efter en så lang periode med fremgang.

Sidste måneds bidrag

↗ Største positive bidragsydere	Vægt (%)	Bidrag (%)	↘ Største negative bidragsydere	Vægt (%)	Bidrag (%)
Dell Technologies Inc	1,56	0,32	Jabil Inc	0,83	-0,05
NetApp Inc	1,07	0,19	International Game Technology PLC	0,22	-0,04
PulteGroup Inc	1,26	0,17	BCE Inc	0,65	-0,03
Equitable Holdings Inc	0,92	0,13	TELUS Corp	0,50	-0,03
DR Horton Inc	1,01	0,12	ON Semiconductor Corp	0,49	-0,03

Bidrag til fondens afkast NOK

Beholdninger

Største beholdninger	Andel (%)	10 største lande	Andel (%)	10 største sektorer	Andel (%)
Dell Technologies Inc	1,4	USA	65,3	Informationsteknologi	22,4
PulteGroup Inc	1,3	Japan	8,3	Finans	15,7
Waste Connections Inc	1,2	Canada	7,6	Industri	12,8
Republic Services Inc	1,2	Nederlandene	2,7	Sundhed	12,1
Cencora Inc	1,2	Tyskland	2,1	Cyklisk forbrug	10,8
Waste Management Inc	1,1	Frankrig	2,0	Kommunikationsservice	7,2
Colgate-Palmolive Co	1,1	Storbritannien	2,0	Stabilt forbrug	6,2
Check Point Software Technologies Ltd	1,1	Israel	1,5	Energi	4,4
NetApp Inc	1,1	Schweiz	1,4	Materialer	3,5
Kimberly-Clark Corp	1,1	Sverige	1,3	Forsyning	2,6
Total andel	11,8 %	Total andel	94,2 %	Total andel	97,8 %

Bæredygtighed

Bæredygtighed



Storebrands bæredygtighedsscore måler både risici og muligheder relateret til bæredygtighed. Scoren rangerer fra 1-10, hvor 10 er den mest bæredygtige, og er baseret på en vurdering af beholdningerne i fonden.

aftryk (ton CO₂e/MNOK)



Et lavt CO₂-aftryk betyder, at en portefølje har en lav eksponering mod CO₂-intensive virksomheder. CO₂-aftrykket måler porteføljevirkomhedernes udledning i CO₂-ækvivalenter i forhold til salgsindtægter. Synlighed heraf er en del af Storebrands forpligtelser over for "Montréal Carbon Pledge" og PDC.

Bæredygtighedskriterier

- ✓ Følger Storebrands standard
- ✓ Følger NBIMs udelukkelsesliste