

Fakta om fondet
ISIN: NO0010776354

Startdato, andelsklasse: 29.03.2017

Startdato, fond: 29.03.2017

Valuta, andelsklasse: NOK

Andelskurs (NAV): 1 646,00 NOK

Forvaltningskapital: 898 MNOK

Referanseindeks: MSCI World NOK hdg

Minste tegningsbeløp: 100 NOK

Fast forvaltningshonorar: 0,77 %

Løpende kostnader: 0,80 %

Antall investeringer: 4

SFDR: Artikkel 8


Andreas Poole
Forvaltet fondet siden
29. mars 2017

Investeringsstrategi

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 Multifactor 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 forvaltes i tråd med Storebrands prinsipper for bærekraftige investeringer.

Storebrand Global Multifaktor Valutasikret A

BÆREKRAFT

RISIKO

AVKASTNING I ÅR

9,65 %
27.03.2024

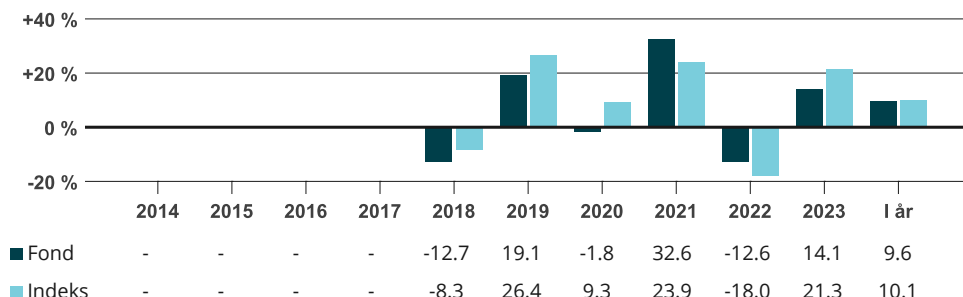
ÅRLIG AVKASTNING

9,03 %
Gjennomsnitt siste 5 år

Månedssrapport for Mars 31.03.2024. Alle tall er i NOK etter avgifter.

Historisk avkastning er ingen garanti for fremtidig avkastning. Fremtidig avkastning vil blant annet avhenge av markedsutviklingen, forvalters dyktighet, fondets risiko og kostnader. Avkastningen kan bli negativ som følge av kurstap.

Historisk avkastning NOK



Referanseindeksen kan benyttes som et referansepunkt for å sammenligne avkastningen i fondet. Indeksen kan også være en kilde for valg av fondets investeringer, men fondets sammensetning kan avvike betydelig fra indeksen.

Periode	Fond (%)	Indeks (%)	Nøkkeltall	1 år	2 år	3 år
Måned	4,63	3,35	Standardavvik	-	-	14,22
Hittil i år	9,65	10,07	Std.avvik indeks	-	-	15,84
12 måneder	24,57	28,55	Tracking error (TE)	-	-	4,73
3 år	7,10	8,54	Information ratio (IR)	-	-	-0,30
5 år	9,03	10,97				
10 år	-	-				
Siden start	7,38	9,84				

Avkastninger over 12 måneder er årlige.

Forvalterkommentar for mars 2024

I mars hadde fondet en verdioppgang på 4,6 prosent, mens referanseindeksen steg 3,4 prosent. Hittil i år er fondet opp 9,6 prosent.

Fondet søker å oppnå meravkastning gjennom høsting av risikopremier. Disse er Verdi, Momentum, Size og Lav-volatilitet, som alle historisk sett har gitt meravkastning (Verdi, Momentum, Size) eller høyere risikojustert avkastning (Lavvol), i forhold til markedet. Hver premie er vektet med 25 prosent i porteføljen. I mars var fondets avkastning 1,4 prosentpoeng bedre enn indeks før honorar. Value var 4 prosentpoeng bedre enn indeks, size var 0,8 prosentpoeng bedre enn indeks, momentum var 2 prosentpoeng bedre enn indeks, mens Lav vol var 1 prosentpoeng dårligere enn indeks. Valutasikring påvirket den relative avkastningen negativt med 0,1 prosentpoeng.

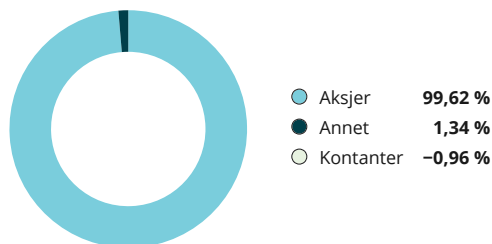
Globale aksjer målt ved MSCI World i lokal valuta steg videre med ytterligere 3 prosent i mars, noe som gjør at oppgangen hittil i år har vært over 10 prosent. Fortsatt gode makrotall og videre bedring i vekstutsikter spesielt i USA, har bidratt til videre aksjeoppgang sammen med duete sentralbanker.

Sentimentet rundt globale aksjer er optimistisk. Dette kan gjøre markedene mer sårbare for skuffelser, samt korreksjoner, etter en så lang periode med oppgang.

Innhold

Største beholdninger	Andel (%)
Storebrand Global Multifactor	99,6
Total andel	99,6 %

Aktivasammensetning



Bærekraft

Bærekraftsscore



Storebrands bærekraftsscore måler både risiko og muligheter knyttet til bærekraft. Scoren går fra 1-10, og er basert på bærekraftsscoren til selskapene i fondet. 10 er best, og betyr at en høy andel av porteføljeselskapene presterer godt på bærekraftsindikatorerne scoren bygger på

Karbonavtrykk (tonn CO₂e/MNOK)



Et lavt karbonavtrykk betyr at en portefølje har en lav eksponering mot karbonintensive selskaper. Karbonavtrykket måler porteføljeselskapenes utslipp i CO₂-ekvivalenter i forhold til salgsinntekter. Synliggjøring av dette er en del av Storebrands forpliktelser til «Montréal Carbon Pledge» og PDC.

Bærekraftskriterier

- ✓ Følger Storebrandstandarden
- ✓ Følger NBIMs utelukkelsesliste