

Storebrand Global Multifactor A



Morningstar Kategori™

Globale, Små-/ mellomstore selskaper

Morningstar sin referanseindeks

Morningstar Global All Cap Target Market

Exposure NR USD

Benyttet i hele rapporten

Fondets referanseindeks

MSCI World NR USD

Morningstar Rating™

★★★★★

Investeringsprofil

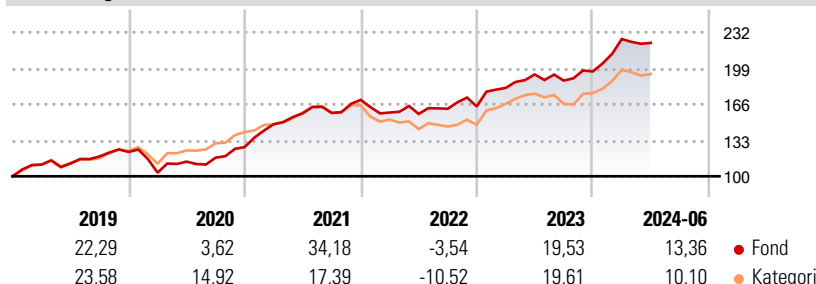
Storebrand Global Multifactor har som mål å oppnå langsiktig meravkastning ved å investere i globale, velutviklede aksjemarkeder. Fondet er et modellbasert faktorfond, som søker å utnytte veldokumenterte risikopremier knyttet til faktorene; verdi, størrelse, momentum og lav volatilitet. Porteføljen er 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	-0,14	3 år Sharpe Ratio	0,90
3 år Beta	0,93	3 år standardavvik	10,63
3 år R2	93,05	3 års risiko	Un.
3 år Info Ratio	-0,05		gj.sn
3 år Tracking Error	4,39	5 års risiko	Gj.sn
		10 års risiko	Un.
			gj.sn

Beregningen bruker Morningstar Global All Cap Target Market Exposure NR USD (hvor indeks kreves)

Avkastning



Løpende avk. %

Løpende avk. %	Fond	Kategori
3 måneder	4,99	5,77
6 måneder	14,67	14,70
1 år	24,60	20,76
3 år ann.	12,98	7,43
5 år ann.	15,22	12,62
10 år ann.	14,22	11,74

Dato 17.07.2024

Kvartalsvis avkastning %

	Q1	Q2	Q3	Q4
2024	15,15	-1,55	-	-
2023	10,35	6,82	-2,93	4,46
2022	-6,85	-0,78	2,98	1,34
2021	16,54	6,75	0,28	7,57
2020	-15,54	9,79	3,21	8,27

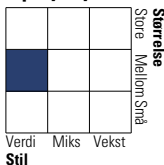
Portefølje 30.06.2024



Porteføljefordeling % Netto

Aksjer	99,84
Obligasjoner	0,00
Kontanter	0,16
Annet	0,00

Equity Style Box™

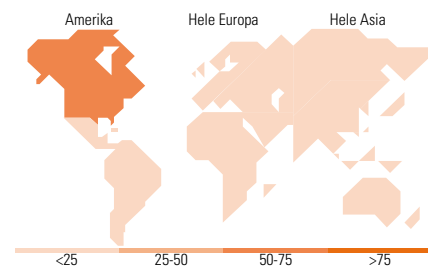


Markedsverdi %

Gigant	3,24
Store	31,93
Middels	48,49
Små	13,39
Mikro	2,95

Markedsverdi NOK

Gj.snitt markedsverdi NOK	190 686,63
---------------------------	------------



Største plasseringer

Beholdning	Sektor	%
Dell Technologies Inc...	IT	1,72
NetApp Inc	IT	1,32
Amphenol Corp Class A	IT	1,27
Waste Connections Inc	Industri	1,19
United Therapeutics Corp	Helsevern	1,19
PulteGroup Inc	Bygging	1,19
Colgate-Palmolive Co	Forbruksvarer	1,17
Republic Services Inc	Industri	1,17
Cencora Inc	Helsevern	1,15
Kimberly-Clark Corp	Forbruksvarer	1,14
% av investeringer i fondets 10 største plasseringer		12,51
Totalt antall aksjer		358
Totalt antall renteinstrumenter		0

Sektorfordeling %

Sektor	Fond
Syklisk	30,61
Materialer	2,88
Konsumentvarer	11,47
Finans	13,45
Eiendom	2,81
Sensitiv	49,00
Kommunikasjon	7,61
Olje & Gass	4,32
Industri	11,28
Teknologi	25,78
Defensiv	20,39
Forbruksvarer	6,03
Helsevern	11,75
Forsyning	2,60

Regionfordeling %

Region	Fond
Amerika	73,34
USA	64,08
Canada	8,29
Latin-Amerika	0,97
Europa	17,50
Storbritannia	2,10
Eurosonen	9,84
Europa - eks. euro	4,23
Europa - Vekstmarkeder	0,00
Afrika	0,00
Midt-Østen	1,32
Asia	9,16
Japan	7,76
Australasia	0,55
Asia - Utviklede markeder	0,85
Asia - Vekstmarkeder	0,00

Fondfakta

Forvalter	Storebrand Asset Management AS	Andelskl. kapital(m)	24 362,98 NOK	Minsteinnskudd	- NOK
Fondets startdato	19.12.2006	(30.06.2024)		Minste sparebeløp	- NOK
Navn på forvalter	Andreas Poole	Domisil	Norge	Kjøpsavgift	-
Forvaltet fondet siden	01.11.2011	Valuta	NOK	Salgsavgift	-
NAV/Kurs (17.07.2024)	NOK 4 715,87	UCITS	Ja	Forvaltningsavgift	0,75%
Forv.kap. (mill.) (30.06.2024)	26 987,91 NOK	Inc eller Acc	Acc		
		ISIN	N00010346422		