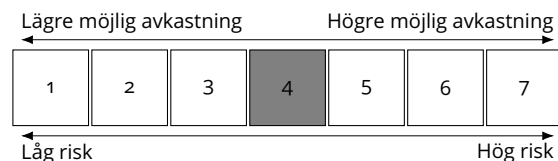


Information om fonden

NorQuant Multi-Asset är en regelbaserad fond som dynamiskt anpassar sig till olika marknadsvillkor. Fonden har som mål att ge en långsiktig avkastning i linje med aktiemarknaden (5-10% per år) men med en betydligt lägre risk. Fonden uppnår en bättre diversifiering än traditionella aktie- och blandfonder genom att investera i fler tillgångsslag: aktier, fastigheter, räntor och råvaror, via likvida och billiga ETF:er (noterade fonder). Fonden investerar inte i derivat och tar inga korta positioner. Allokeringen i fonden bestäms utifrån en kvantitativ modell som väljer tillgångsklasser med bäst momentum. Kortsiktig volatilitet och korrelation används för att sätta ihop en optimerad portfölj. Fonden har inga begränsningar på hur stor andel som kan investeras i de olika tillgångsslagen. Fonden investerar globalt och har därmed en valutarisk. Fonden klassificeras som en blandfond med måttlig risk och har UCITS-status.

Riskprofil



Risk/avkastningsindikatorn visar sambandet mellan risk och möjlig avkastning för dig som investerar i Fonden. Riskkategoriseringen baseras på simulerade och/eller historiska portföljdata och beskriver priskänsligheten för fondens positioner under de senaste fem åren.

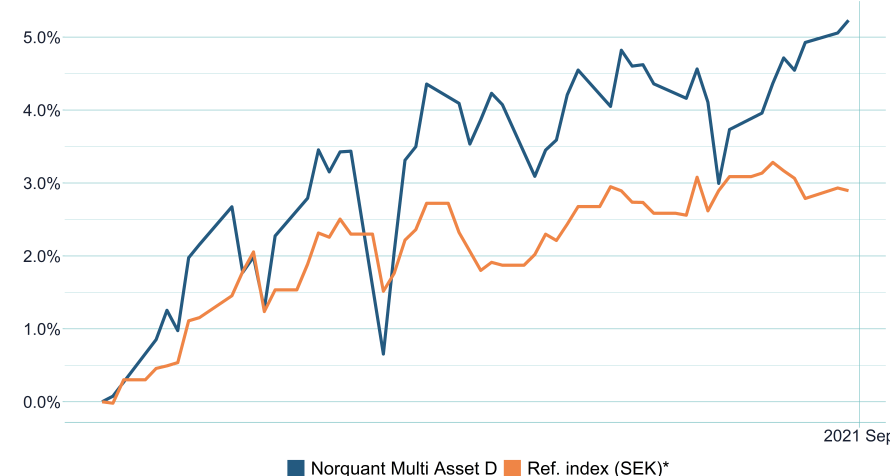
Fonden tillhör kategori 4, vilket innebär medel till hög chans/risk för upp- eller nedgångar i andelsvärdet.

Marknadskommentar



NorQuant Multi-Asset visade en positiv avkastning i augusti på 1,1 %, något bättre än jämförelseindex. Fondens exponering mot amerikanska aktier och europeiska småbolag visade sig positivt medan investeringarna i råvaror och asiatiska aktier tappade något i värde. För september flyttas ca. 10 % av tillgångarna från råvaror till fastigheter. Exponeringarna mot de olika tillgångsslagen är nu 47% aktier, 27% råvaror och 26 % fastigheter.

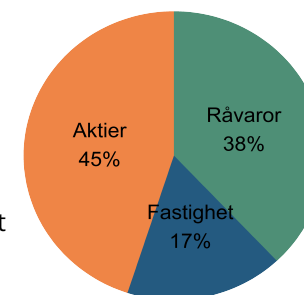
Fondavkastning sedan start



| Fond/index | Avkastning sedan start | Avkastning månaden | Årlig Volatilitet |
|--------------------------|------------------------|--------------------|-------------------|
| NorQuant Multi-Asset D** | 5.2 % | 1.1 % | 10.6 % |
| Referensindex (SEK)* | 2.9 % | 1.0 % | 4.2 % |

Största innehav och tillgångsklasser

| Aktiva | Andel | Klass |
|--------------------|--------|-----------|
| All Commodities | 14.4 % | Råvaror |
| Core Commodities | 14.4 % | Råvaror |
| MSCI USA | 12 % | Aktier |
| USA Eiendom | 11.7 % | Fastighet |
| Asia Pacific ex JP | 10.9 % | Aktier |



* 50 % Solactive Broad Global Developed Government Bond i SEK och 50 % globala aktier i SEK (MSCI ACWI)

** Avkastning efter kostnader