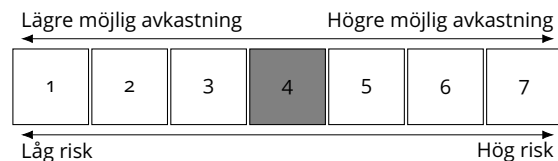


### Information om fonden

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.

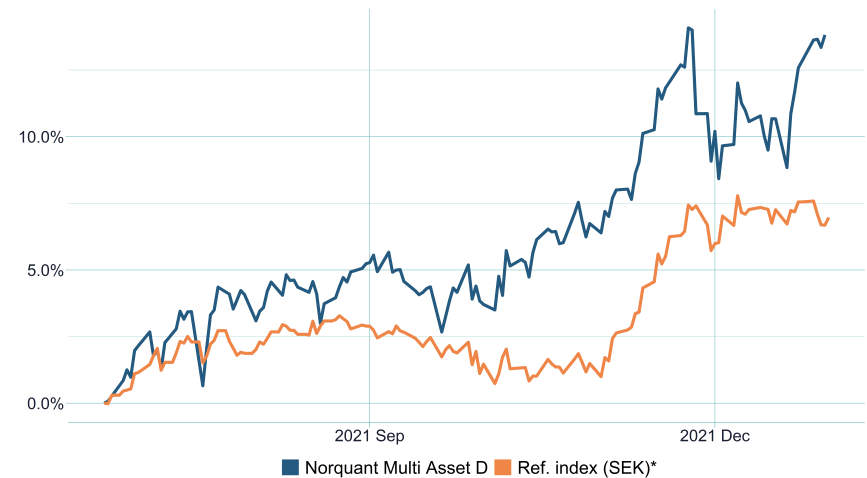
**Fonden tillhör kategori 4**, vilket innebär medel till hög chans/risk för upp- eller nedgångar i andelsvärdet.

### Marknadskommentar



NorQuant Multi-Asset avslutade 2021 starkt. Fonden steg med 4,3% i december, medan jämförelseindex steg 1,2%. Överavkastningen för denna månad var alltså hela + 3,1%. Investeringar i råvaror, USA/globala fastigheter och europeiska aktier bidrog mest positivt medan europeiska fastigheter och NASDAQ påverkade avkastningen negativt. En stark norsk krona försvagade resultatet i december mätt i norska kronor. NorQuant Multi-Asset har genererat en avkastning på +13,8% sedan starten i juni, exakt 6.8% bättre än jämförelseindex. För januari ökas exponeringen mot börsnoterade fastigheter till 33%. Aktieinvesteringar minskade till 43% och exponeringen mot råvaror är oförändrad på 24%.

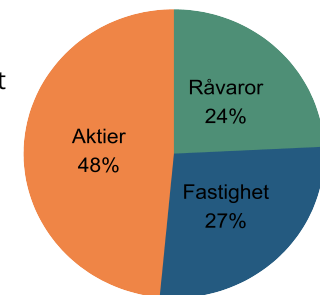
### Fondavkastning sedan start



Fond/index	Avkastning sedan start	Avkastning månaden	Årlig Volatilitet
NorQuant Multi-Asset D**	13.8 %	4.3 %	11.9 %
Referensindex (SEK)*	7.0 %	1.2 %	5.9 %

### Största innehav och tillgångsklasser

Aktiva	Andel	Klass
USA Eiendom	14.5 %	Fastighet
NASDAQ-100	14.3 %	Aktier
All Commodities	14.2 %	Råvaror
MSCI USA	13.5 %	Aktier
MSCI Europe	13.1 %	Aktier



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

\*\* Avkastning efter kostnader