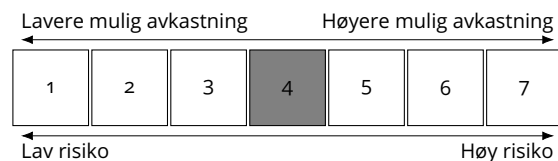


Informasjon om fondet

NorQuant Multi-Asset er et regelstyrt fond som dynamisk tilpasser seg forskjellige markedsforhold. Fondet har som mål å gi en langsiktig avkastning på linje med aksjemarkedet (5-10% per år) men med vesentlig lavere risiko. Fondet oppnår en bedre diversifisering enn tradisjonelle aksje- og kombinasjonsfond ved å investere i flere aktivaklasser: aksjer, eiendom, renter og råvarer, via likvide og billige ETFer (børsnoterte fond). Fondet er «long only», og investerer ikke i derivater. Allokeringen i fondet bestemmes ut ifra en kvantitativ modell som velger ut aktivaklasser med best momentum. Kortsiktig volatilitet og korrelasjon brukes for å sette sammen en optimalisert portefølje. Fondet har ingen begrensninger for hvor stor andel som kan allokere til de ulike aktivaklassene. Fondet investerer globalt og har dermed en valutarisiko. Fondet er klassifisert som et kombinasjonsfond med moderat risiko og har UCITS-status.

Risikoprofil



Risiko/avkastningsindikatoren viser forholdet mellom risiko og mulig avkastning når du investerer i andelsklassen. Risikokategorien for andelsklassen er basert på simulert og/eller historisk porteføljedata og beskriver prissensitiviteten til Fondets posisjoner over de siste fem år.

Denne andelsklassen tilhører kategori 4, som betyr middels til høy sjans/risiko for opp- eller nedgang i andelsverdien.

Markedskommentar



NorQuant Multi-Asset avsluttet 2021 sterkt. Fondet steg 1,4% i desember, mens referanseindeksen falt 1,9%. Meravkastningen for denne måneden ble dermed hele +3,3%. Investeringene i råvarer, amerikansk/global eiendom og europeiske aksjer bidro mest til det positive resultatet, mens europeisk eiendom og NASDAQ påvirket avkastningen negativt. En sterk norsk krone i desember svekket resultatet målt i norske kroner. NorQuant Multi-Asset har levert en avkastning på +18,9% siden oppstarten i januar, nøyaktig 10% bedre enn referanseindeksen. For januar økes eksponeringen mot børsnotert eiendom til 33%. Aksjeinvesteringene reduseres til 43% og eksponeringen mot råvarer holdes uendret på 24%.

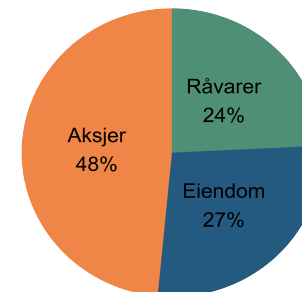
Fondsavkastning siden start



Fond / Indeks	Avkastning Siden start	Avkastning Siste måned	Årlig Volatilitet
NorQuant Multi-Asset**	18.9 %	1.4 %	10.6 %
Referanseindeks (NOK)*	8.9 %	-1.9 %	7.4 %
OSEBX	20.3 %	1.7 %	13.6 %

Største plasseringer og aktivaklasser

Aktiva	Andel	Klasse
USA Eiendom	14.5 %	Eiendom
NASDAQ-100	14.3 %	Aksjer
All Commodities	14.2 %	Råvarer
MSCI USA	13.5 %	Aksjer
MSCI Europe	13.1 %	Aksjer



* 50 % Solactive Broad Global Developed Government Bond i NOK og 50 % globale aksjer i NOK (MSCI ACWI)

** Avkastning etter kostnader