

NorQuant Multi-Asset er et regelstyrt, kvantitativt fond, som ønsker å utnytte veldokumenterte risikopremier knyttet hovedsakelig til momentum-faktoren. Fondet har som mål å oppnå høy og stabil avkastning ved å ikke bare investere i aksjemarkedet, men også i andre aktivaklasser som rentepapirer, eiendom og råvarer. Byggeklossene i vårt Multi-Asset fond er inntil 30 forskjellige ETFer som følger ulike aktivaklasser. NorQuant Multi-Asset er et bedre og mer dynamisk alternativ til tradisjonelle aksje- og rentefond, og skal gi lavere risiko mot tradisjonelle risikofaktorer.

- ◆ **Fondet** investerer i verdens mest likvide og billige ETF-er (børsnoterte fond) og har som mål å oppnå en avkastning på linje med det globale aksjemarkedet, men med betydelig lavere risiko.
- ◆ **NorQuant Multi-Asset** oppnår en bedre diversifisering enn tradisjonelle kombinasjonsfond ved å investere i flere forskjellige aktivaklasser gjennom ETFer i aksjer, eiendom, renter og råvarer.
- ◆ Forskningen vår viser at bruk av **momentum** i aktivaklasser gir høyere avkastning.
- ◆ Kortsiktig **volatilitet og korrelasjon** brukes for å sette sammen en optimalisert portefølje.
- ◆ **Konservativ strategi** ved å kontinuerlig justere risikoprofil etter hvordan markedene utvikler seg.

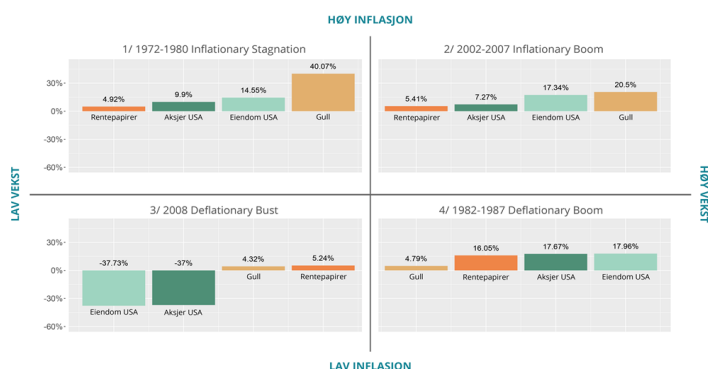
NorQuant Multi-Asset er et UCITS-fond med daglig likviditet. Årlig forvaltningsgebyr: inntil 0,99% / Minsteinnskudd: 100 kr

Investeringsfilosofi:

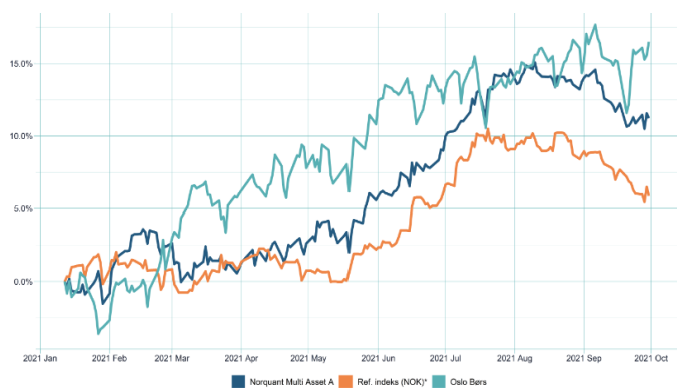
NorQuant ønsker å tilby private og profesjonelle investorer og tradere i Norden strategier med banebrytende datavitenskap som hoved-faktor for beslutningsprosessen. Vårt analyseteam består av PhDs og eksperter innen kvantitativ finans, maskinlæring (A.I.) og matematikk, kombinert med praktisk erfaring fra institusjonell kapitalforvaltning og trading. Vi bruker denne kunnskapen og erfaringen til å utvikle mer avanserte strategier enn det som inntil nå har vært åpent tilgjengelig for investorer og tradere i Norden.

- ◆ **Regelstyrt og systematisk forvaltning:** Jobber kontinuerlig med nye metoder som integreres og automatiseres i forvaltningen.
- ◆ **Tilgang på de beste data:** NorQuant bruker samme finansielle datasett som Oljefondet (Factset), og klimadata fra Nord universitet. Vi bruker banebrytende teknologier for å renske, behandle og analysere disse dataene med distribuert cloud computing.
- ◆ **Avanserte kvantitative analyser:** NorQuant bygger på forskning fra nobelprisvinnende og verdensledende miljøer, og har høy intern kompetanse fra Oljefondet.
- ◆ **ESG:** Sentral del av vårt forskning- og utviklingsarbeid, og er et essensielt element i valg av investeringer. NorQuant AS har fått innvilget 14 MNOK i støtte fra Forskningsrådet til et 4-årig forskningsprosjekt innen ESG og maskinlæring.
- ◆ **Maskinlæring:** Gjennom vårt forskningsprosjekt utvikler vi avanserte og revolusjonerende metoder for automatisk å finne signaler i store mengder data. Dette gir NorQuant et forsprang sammenlignet med tradisjonelle metoder og aktører.

Ulike aktivaklasser bidrar i ulike faser



Utvikling NorQuant Multi-Asset



Fond/Indeks	Siden start	Siste måned
NorQuant Multi-Asset	+11,2 %	-2,2 %
Referanseindeks (NOK)*	+5,9 %	-2,6 %
OSEBX	+16,5 %	+1,9 %

Avkastning etter kostnader

Hvorfor investere i NorQuant Multi-Asset:

- ◆ **Stabil avkastning** over tid.
- ◆ **Lav samvariasjon** med andre fond og investeringer.
- ◆ Bygget på kompetanse og erfaring fra pionérene innenfor kvantitativ forvaltning fra **Oljefondet**.
- ◆ **Regelstyrt og vitenskapelig** forvaltning.
- ◆ **Diversifisert** og likvid portefølje med verdens mest likvide og billige ETFer.
- ◆ **Lave kostnader.**
- ◆ **Daglig likviditet** (kjøp/salg) og kursnotering.
- ◆ NorQuant Kapitalforvaltning har konsesjon fra Finanstilsynet til porteføljeforvaltning og ordreformidling, og skal lansere nyskapende, kvantitative fond.
- ◆ Vårt første fond er **NorQuant Multi-Asset**.