

Marknadskommentar

Fonden steg i mars med 6,3 procent och fick fin utdelning från att ha följt den starka trend som just nu råder på aktiemarknaden. Stockholmsbörsen steg med 5,7 procent men omräknat i svenska kronor var exempelvis utvecklingen på såväl breda amerikanska som europeiska aktieindex ännu högre; 6,4 respektive 6,8 procent. Placeringarna i räntebärande instrument och börsnoterade fastigheter gav också ett tillskott till avkastningen på över 50 punkter, även om andelen räntor och fastigheter bara utgjorde 19 procent respektive 6 procent av portföljen i slutet av månaden.

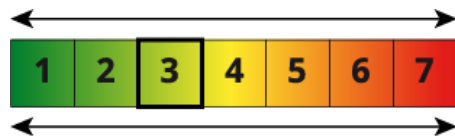
Sedan fondstart i juni 2021 är totalavkastningen för fonden +32,2 procent mot +23,0 procent för jämförelseindex.

Information om fonden

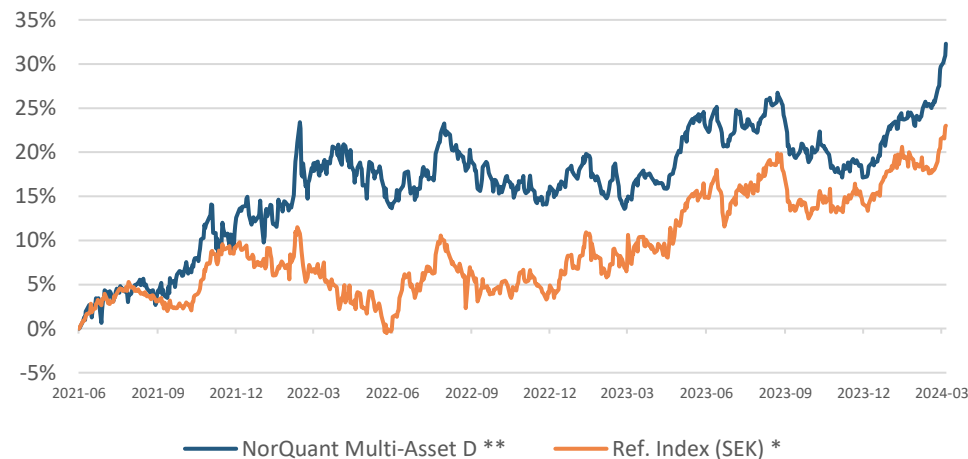
NorQuant Multi-Asset är en regelbaserad fond som dynamiskt anpassar sig till olika marknadsvillkor. Fonden har som mål att ge en långsiktig avkastning i linje med aktiemarknaden (5-10% per år) men med en betydligt lägre risk. Fonden uppnår en bättre diversifiering än traditionella aktie- och blandfonder 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. Kategoriseringen baseras på simulerade och/eller historiska portföljdata och beskriver priskänsligheten för fondens positioner under de senaste fem åren. Fonden tillhör kategori 3, vilket innebär medel till hög chans/risk för upp- eller nedgångar i andelsvärdet.



Avkastning



	Avkastning sedan start	Avkastning månaden	YTD	Årlig volatilitet	Sharpe ratio
NorQuant Multi-Asset D **	32,3 %	6,3 %	11,7 %	10,7 %	0,99
Ref. Index (SEK) *	23,0 %	4,6 %	8,9 %	10,4 %	0,77

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

** Avkastning efter kostnader

Största innehav

Innehav	Andel	Klass	Avkastning
MSCI USA	15.3 %	Aktier	6.4 %
MSCI Europe	15.3 %	Aktier	6.8 %
MSCI Japan	13.1 %	Aktier	6.3 %
Europe Corp. Bond	11.5 %	Räntor	4.0 %
Emerging Markets	11.5 %	Aktier	5.8 %

Tillgångsfördelning

