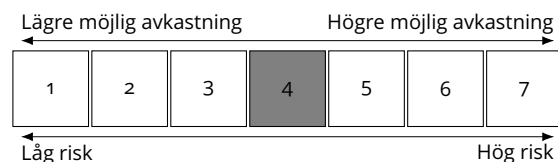


Information om fonden

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.

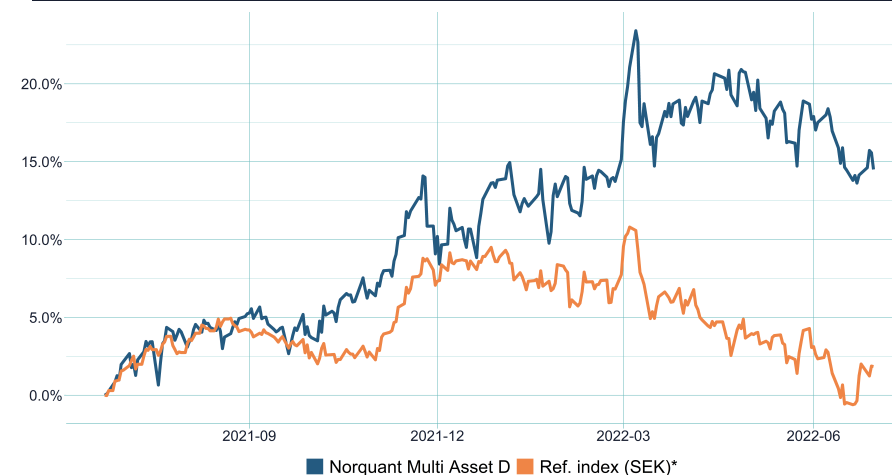
Fonden tillhör kategori 4, vilket innebär medel till hög chans/risk för upp eller nedgångar i andelsvärdet.

Marknadskommentar



NorQuant Multi-Asset hade en utveckling i juni på -2,7 procent, vilket är 1,5 procentenheter svagare än jämförelseindexet som tappade 1,2 procent. Fondens investeringar i framför allt asiatiska och europeiska aktier sänkte resultatet, medan amerikanska stats- och företagsobligationer hade en positiv effekt på resultatet. Sedan starten för den svenska andelsklassen i juni 2021 har NorQuant Multi-Asset levererat en mycket stark avkastning på +14,5 procent. Det är 12,7 procentenheter bättre än jämförelseindex som under samma tidsperiod har stigit med 1,8 procent. När vi nu går in i juli ökas exponeringen mot räntebärande investeringar från 29 till 35 procent. Och det blir på bekostnad av samtliga övriga tillgångsslag där såväl aktier (från 31 till 28 %), råvaror (från 20 till 18 %) och börsnoterade fastigheter (från 20 till 19 %) minskas.

Fondavkastning sedan start



Fond/Index	Avkastning sedan start	Avkastning månaden	YTD	Årlig Volatilitet
NorQuant Multi-Asset D**	14.5 %	-2.7 %	0.6 %	14.0 %
Referensindex (SEK)*	1.8 %	-1.2 %	-6.5 %	8.5 %

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

** Avkastning efter kostnader

Största innehav och tillgångsklasser

Aktiva	Andel	Klass
US Treasury Bond	14.5 %	Obligation
Global REITs	14.4 %	Fastighet
US Corp. Bond	14.4 %	Obligation
MSCI Europe	14.2 %	Aktier
All Commodities	10.5 %	Råvaror

