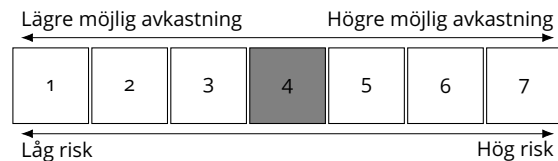


Information om fonden

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.

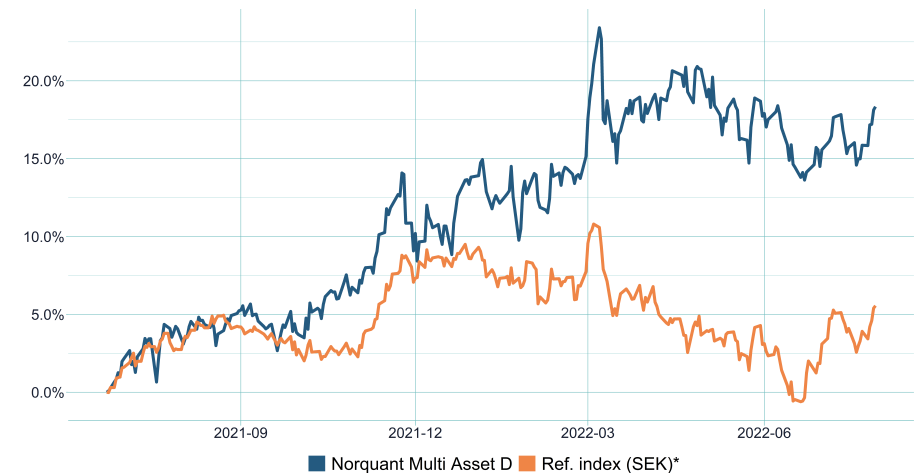
Fonden tillhör kategori 4, vilket innebär medel till hög chans/risk för upp eller nedgångar i andelsvärdet.

Marknadskommentar



NorQuant Multi-Asset hade en positiv utveckling under månaden och steg med 3,4 procent, vilket var marginellt mindre än fondens jämförelseindex som steg med 3,6 procent. Det var framför allt fondens investeringar i aktier och börsnoterade fastigheter som bidrog mest till den positiva utvecklingen. Sedan starten i juni 2021 har den svenska andelsklassen av fonden levererat en avkastning på +18,3 procent – vilket är 12,7 procentenheter bättre än jämförelseindex som har stigit med 5,6 procent. För augusti ökar vi ytterligare fondens investering i räntebaserade investeringar till 35 procent samtidigt som exponeringen mot aktier sänks ytterligare till 24 procent.

Fondavkastning sedan start



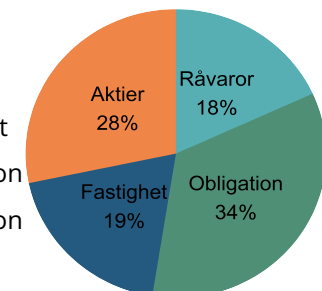
Fond/Index	Avkastning sedan start	Avkastning månaden	YTD	Årlig Volatilitet
NorQuant Multi-Asset D**	18.3 %	3.4 %	4.0 %	13.7 %
Referensindex (SEK)*	5.6 %	3.6 %	-3.0 %	8.5 %

* 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
MSCI Europe	14.3 %	Aktier
Global REITs	14.1 %	Fastighet
US Treasury Bond	13.6 %	Obligation
US Corp. Bond	13.5 %	Obligation
All Commodities	8.4 %	Råvaror



Disclaimer

NorQuant Kapitalforvaltning AS (med organisationsnummer 822 651 992) är ett värdepappersföretag med tillstånd från Finanstilsynet i Norge. Informationen ska inte tolkas som råd eller rekommendationer om köp eller försäljning av finansiella instrument eller värdepapper. Bolaget tar inte ansvar för handlingar som utförs utifrån informationen på dessa sidor. Alla investeringar innebär en risk och sådana beslut fattas självständigt och på egen risk. Informationen på dessa sidor bör inte användas i stället för den professionella rådgivning individer eller företag kan behöva, och företaget kan inte garantera att informationen är korrekt eller fullständig.