

Markedskommentar

NorQuant Multi-Asset hadde en positiv måned og steg med 2,8 % i februar. Dette var 0,1 % bedre enn referanseindeksen som steg 2,7 % i denne måneden. Særlig investeringene i amerikanske og japanske aksjer bidro til den positive avkastningen, mens eksponeringen mot obligasjoner dro resultatet ned. Valutabevegelsene påvirket fondets resultat positivt denne måneden. Både den amerikanske dollaren og euroen styrket seg med ca.

1% mot norske kronen i februar. Siden oppstarten i januar 2021, for litt over 3 år siden, har NorQuant Multi-Asset levert en meget sterk avkastning på 36,7 % etter kostnader. Dette er 14,8 % bedre enn referanseindeksen som kun har steget 21,9 %. Resultatet er oppnådd med en moderat volatilitet på 10,4 %. I februar var fondets investeringer vektet ca. 68 % mot aksjer og ca. 32 % mot obligasjoner.

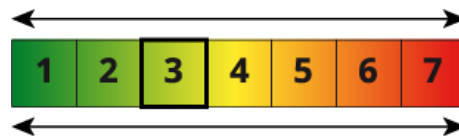
Informasjon om fondet

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.

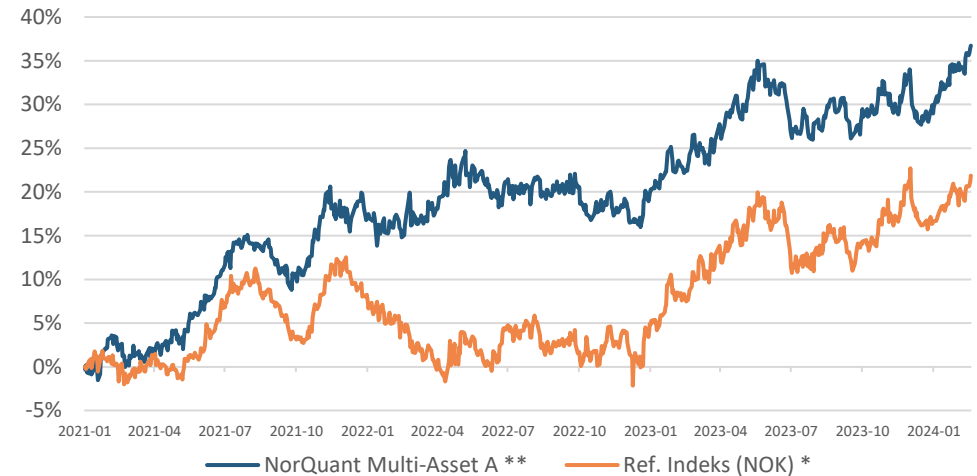
Allokeringen i fondet bestemmes ut ifra en kvantitativ modell som velger ut aktivaklasser med best momentum. Kortsiktig volatilitet og korrelasjon brukes for å sette sammen en optimalisert portefølje. Fondet har ingen begrensninger for hvor stor andel som kan allokere til de ulike aktivaklassene. Fondet 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 Fondet. Risikokategorien for Fondet er basert på simulert og/eller historisk porteføljedata og beskriver prissensitiviteten til Fondets posisjoner over de siste fem år. Fondet tilhører kategori 3, som betyr middels til høy sjanse/risiko for opp eller nedgang i andelsverdien.



Avkastning



	Avkastning siden start	Avkastning siste måned	YTD	Årlig volatilitet	Sharpe ratio
NorQuant Multi-Asset A **	36,7 %	2,8 %	6,7 %	10,4 %	1,01
Ref. Indeks (NOK) *	21,9 %	2,7 %	4,9 %	11,5 %	0,61

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

Største plasseringer

Aktiva	Andel	Klasse	Avkastning periode
MSCI Europe	16,2 %	Aksjer	3,1 %
Europe Corp. Bond	16,2 %	Rentepapirer	0,4 %
MSCI USA	15,0 %	Aksjer	5,8 %
MSCI Japan	13,1 %	Aksjer	5,2 %
NASDAQ-100	11,7 %	Aksjer	5,8 %

Aktivafordeling

