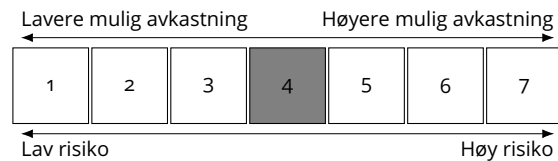


### Informasjon om fondet

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 4**, som betyr middels til høy sjans/risiko for opp eller nedganger i andelsverdien.

### Markedskommentar



NorQuant Multi-Asset hadde en negativ utvikling i juni på -2.4 %, noe som er 1.5 % svakere enn referanseindeksen, som falt 0.9 %. Særlig fondets investeringer i asiatiske og europeiske aksjer dro resultatet ned, mens eksponeringen mot amerikanske stats- og selskapsobligasjoner påvirket resultatet positivt. Valutabevegelsene i juni var i fondets favør og påvirket avkastningen målt i norske kroner klart positivt. Dollarkursen styrket seg ca. 4.9 % i løpet av måneden og euroen steg ca. 2.8 %. Siden oppstarten i januar 2021 har NorQuant Multi-Asset levert en meget sterk avkastning på +18.2%. Dette er +17% bedre enn referanseindeksen som har steget kun +1.2%. For juli reduseres fondets investeringer i aksjer fra 31 % til 28 %. Eksponeringen mot obligasjon økes fra 29 % til 35 %. Eiendom og råvare andelen holdes relativt uendret på hhv. 19 % og 18 %.

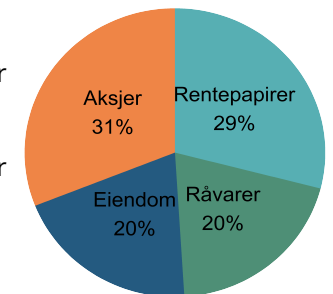
### Fondsavkastning siden start



Fond / Indeks	Avkastning Siden start	Avkastning Siste måned	YTD	Årlig Volatilitet
NorQuant Multi-Asset**	18.2 %	-2.4 %	-0.5 %	11.4 %
Referanseindeks (NOK)*	1.2 %	-0.9 %	-7.5 %	8.7 %

### Største plasseringer og aktivaklasser

Aktiva	Andel	Klasse
US Treasury Bond	14.5 %	Rentepapirer
Global REITs	14.4 %	Eiendom
US Corp. Bond	14.4 %	Rentepapirer
MSCI Europe	14.2 %	Aksjer
All Commodities	10.5 %	Råvarer



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

\*\* Avkastning etter kostnader

#### Disclaimer

NorQuant Kapitalforvaltning AS (org.nr. 822 651 992) er et verdipapirforetak med konsesjon fra Finanstilsynet. Informasjonen er ikke å betrakte som råd eller anbefalinger om kjøp eller salg av finansielle instrumenter eller verdipapirer. Selskapet påtar seg ikke ansvar for handlinger utført på bakgrunn av informasjon på disse sidene. Alle investeringer innebærer risiko, og slike beslutninger tas selvstendig og på eget ansvar. Informasjonen på disse sidene skal ikke brukes istedenfor den profesjonelle rådgivningen enkeltpersoner eller bedrifter kan ha behov for, og selskapet kan ikke garantere for at informasjonen er presis eller fullstendig.