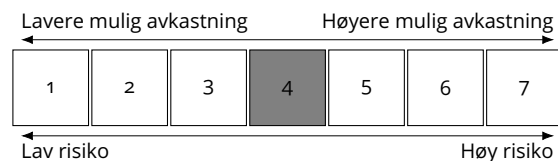


Informasjon om fondet

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 andelsklassen. Risikokategorien for andelsklassen er basert på simulert og/eller historisk porteføljedata og beskriver prissensitiviteten til Fondets posisjoner over de siste fem år.

Denne andelsklassen tilhører kategori 4, som betyr middels til høy sjans/risiko for opp- eller nedgang i andelsverdien.

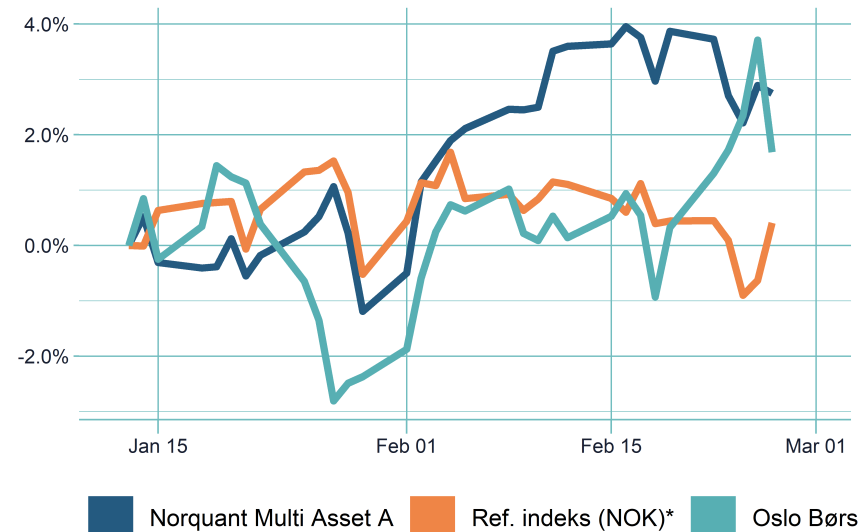
Markedskommentar



NorQuant Multi-Asset steg 3,99% i februar, noe som er mer enn 3% bedre enn referanseindeksen. Grunnen til meravkastningen denne måneden var fondets overvekt i aksjer, sterke råvarepriser, og en dollar og euro som styrket seg med nesten 1%. Siden oppstart er fondet +2,75% mot referanseindeksens +0,41%. For mars øker fondet eksponeringen mot råvarer til 35%. Aksjer utgjør resten av porteføljen på 65%.

Thomas Nygaard

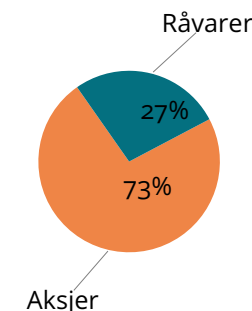
Fondsavkastning siden start



Fond / Indeks	Siden start	Siste måned
NorQuant Multi-Asset	+2.75%	+3.99%
Referanseindeks (NOK)*	+0.41%	+0.93%
OSEBX	+1.68%	+4.15%

Største plasseringer og aktivaklasser

Aktiva	Andel	Klasse
Japan	15.9 %	Aksjer
Emerging Markets	15.6 %	Aksjer
Europe Small Cap	12.2 %	Aksjer
Råvarer	11.7 %	Råvarer
NASDAQ-100	9.7 %	Aksjer



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