

NorQuants kombinasjonsfond slår indeksen

NorQuant feirer i dag 1-årsdagen til selskapets første fond, kombinasjonsfondet NorQuant Multi-Asset. Med en strategi basert på omfattende forskning og eksponering mot flere aktivaklasser enn de fleste kombinasjonsfondene, har fondet lyktes med å slå indeksene med høy margin i løpet av det første året.

NorQuant Kapitalforvaltning lanserte fondet NorQuant Multi-Asset 11. januar 2021. Fondet er et kombinasjonsfond som investerer i aksjer, renter, råvarer og eiendom og har dermed flere aktivaklasser å investere i enn de fleste kombinasjonsfondene på markedet som vanligvis kun investerer i aksjer og renter. Fondet forvaltes basert på en regelbasert strategi hvor porteføljen justeres dynamisk etter trenden ulike aktivaklasser befinner seg i. Forvaltningen er fleksibel med hensyn til hvor mye av kapitalen som kan være investert i individuelle aktivaklasser og markeder, noe som betyr at det kan også dra nytte av mer kortsiktige svingninger, og raskt tilpasse risikonivået.

Ett år etter lanseringen har fondet gitt en avkastning på +16,9 prosent, sammenlignet med +6,8 prosent for referanseindeksen.

– Vi er svært fornøyd med hvordan fondet har fungert og med avkastningen både i absolutte tall, risikojustert, og i forhold til fondets referanseindeks og konkurrenter, sier Thomas Nygaard, ansvarlig forvalter og daglig leder i NorQuant Kapitalforvaltning.

Fondsstrategien er utviklet for å skape avkastning fra ulike aktivaklasser som er i en positiv trend. Fondet fanget raskt opp den positive trenden innen råvarer og hadde derfor på det meste en råvareeksponering på 45 prosent i løpet av året. Eksponering mot råvarer var den største enkeltstående bidragsyteren til den gode avkastningen i løpet av året (43 % av avkastningen kom fra råvarer), etterfulgt av aksjer (35 %), og eiendom (22 %).

– Vi hadde en betydelig høyere eksponering mot råvarer i løpet av året enn de 5-10 prosentene som vi forventer å ha over tid, men det viser tydelig at strategien lykkes med å fange opp og utnytte spesielle markedsforhold og trender, sier Thomas Nygaard.

En mer detaljert beskrivelse av fondets utvikling det første året finner du [her](#).

For mer informasjon kontakt
Thomas Nygaard, daglig leder +47 991 22 033

NorQuant Kapitalforvaltning er et norsk verdipapirselskap eid av fintechselskapet NorQuant AS med i overkant av 500 aksjonærer. Selskapet streber etter å bli den ledende aktøren innen kvantitativ regelstyrt kapitalforvaltning i Norden. Med et analyseteam bestående av eksperter innen kvantitativ finans, maskinlæring og matematikk, kombinert med praktisk erfaring fra institusjonell kapitalforvaltning, utvikler selskapet innovative forvaltningsstrategier for automatisk å finne signaler i store datamengder. Selskapet forvalter i dag fondene NorQuant Multi-Asset og NorQuant ESG. Fondene er tilgjengelige bl.a. på Nordnet, Pareto, Njord, og via de fleste banker og meglerhus på forespørsel.

For mer informasjon om selskapet, besøk www.norquant.no