

SEB True Market Neutral började bra i Q4

Stockholm (HedgeFonder.nu) – SEB True Market Neutral visade sin näst bästa månadsavkastning som fond i oktober, där man avslutade månaden på +1,42%. Endast en kvantitativ förvaltare i fond-i-fondportföljen bidrog negativt till resultatet. Fonden tog sig igenom sommarens och höstens volatila marknadsförutsättningar – som sopade undan mer än 20% av aktievärdet – tämligen oförändrad med låg volatilitet. Hittills i år är fonden upp 4,22% med en Sharpekvot på 1,69. Barclay Hedge Fund of Fund Index är ner mer än 5% under samma period.

Portföljen av fonder inom SEB True Market Neutral erbjuder investerare exponering mot ett urval av högkvalitativa Market neutral-hedgefonder. Fonderna väljs ut i en strukturerad process som inkluderar en grundlig due diligence och utvärdering baserad på både dess egna meriter, samt även deras bidrag till den totala portföljen.

SEB:s True Market Neutral-fond har blivit den första nordiska fond-av-hedgefonder att få betyget “AA” av det ledande globala kreditvärderingsinstitutet Standard & Poor’s (S&P).

S&P säger om den svenska kapitalförvaltaren, “SEB förtjänar beröm för sin mycket disciplinerade process att uppnå fondens mål under perioder då de allra flesta fonder-av-hedgefonder har misslyckats. Till exempel gav fonden en avkastning på +3% under 2008 och har fortsatt att ge positiv avkastning varje år.”

Fonden, som riktar sig mot institutionella investerare, syftar till att ge en årlig avkastning på 3-4 procentenheter över den riskfria räntan och att inte avvika mer än 5 procentenheter från målet och att inte ha någon korrelation till aktiemarknaden.

Dessutom har S&P också givit SEB:s hedgefonder Dynamic Manager Alfa och Asset Selection betyget “AA”.