Bridgewaters flagskepp upp 36% under 2011

Stockholm (HedgeFonder.nu) – Bridgewaters Pure Alpha Fund, världens största hedgefond med cirka 72 miljarder USD i förvaltat kapital, steg med 0.9% (brutto före avgifter) under fjärde kvartalet 2011, vilket gjorde att avkastningen för helåret stannade på starka 36.4%, rapporterar Opalesque. Förvaltningstrategin har en genomsnittlig årlig avkastning på 22.2% sedan december 1991 och fonden har en årlig snittavkastning på 20% sedan starten i maj 2005.

Under det fjärde kvartalet kom de största vinsterna från positioner i amerikanska aktier, indiska rupier och olja. De största förlusterna kom från positioner i guld och Euro/Australiensiska dollar-crosspositioner. Förvaltarna säger själva att de förväntar sig ett ”dramatiskt 2012” då mycket av spänningarna i världen kvarstår att lösa upp.

Bridgewater Associates är en amerikansk kapitalförvaltare grundad av Ray Dalio, i en liten lägenhet 1975. Företaget, baserat i Westport, Connecticut, har en investeringsstil baserad på global macro och har mestadels institutionella kunder och förvaltar hissnande 120 miljarder USD. Enligt företagets egen hemsida blev de åren 2010 och 2011 rankade som både den största och bäst avkastande fondförvaltaren i världen.

The Texas Teacher Retirement System – lärarnas pensionsfond i staten Texas – köpte förra månaden en andel i Bridgewater för motsvarande 250 mUSD. Detta steg var en del av Ray Dalios plan för att minska sin andel om 60% i företaget, till cirka 20% under de närmaste 10 åren.

Bild: (C)shutterstock Nagy Bagoly Arpad