

SEBs hedgefonder höll ställningarna under april / maj

Stockholm (HedgeFonder.nu) - SEBs två fond-av-hedgefonder visade olika resultat när siffrorna för april 2012 släpptes tidigare. SEB Dynamic Manager Alpha lyckades gå upp med 0,53%, vilket ger totalt +1,3% per den 30 april. SEB True Market Neutral Portfolio halkade ner på röda siffror för månaden med -0,23%, hittills i år 0,82% per 30 april.

Dynamic Manager Alpha ger exponering mot en diversifierad portfölj av skickliga förvaltare genom att extrahera "alfa" ur traditionella aktiefonder genom en diciplinerad säkring av marknadsrisk. Marknadsneutralitet strävar man efter att uppnå genom dynamiska hedgestrategier.

SEB True Market Neutral Portfolio erbjuder exponering mot ett urval av marknadsneutrala aktiehedgefonder av hög klass. Fondens förvaltare letar efter investeringar i underliggande fonder som är utvalda genom en strukturerad process inkluderande grundlig due diligence och utvärdering baserat både på deras egna meriter och bidraget till den totala portföljen.

Om man tittar på singelstrategifonderna inom SEB så sjönk andelsvärdet för SEB Hedge Fixed Income med -0,07% under maj. Fonden hade låg allokering till riktningstrategier och gynnades i början på månaden av flera relativ-värdestrategier. Under månadens slut fick det accellerande räntefallet tillsammans med viss bankoro, samt i Sveriges fall stark statistik, penningmarknadskurvorna att flacka kraftigt. Detta påverkade fondens avkastning negativt.

Efter maj månads resultat som var i princip oförändrat, står fonden på 0,31% för helåret 2012.

CTA-strategin bland SEBs hedgefonder, SEB Asset Selection steg 1,3% i maj (-2,52 hittills i år), vilket generellt sett var en bra månad för trendföljande Managed Futures-fonder.

SEBs Global Quant-team lett av Hans-Olov Borneman tjänade pengar (procentuellt sett) på fixed income (+3,7%) och valutor (+0,4%). Andra sektorer bidrog negativt till månadsavkastningen: aktier (-1,7%) och råvaror (-0,1%). Andra effekter var negativa (-1,0%). I termer av portföljrisk så uppgick den realiserade 30 dagars volatiliteten till 5,0%.

Bild: (c) shutterstock—Andrey Burmakin