Coeli lanserar ny hedgefond-i-fond

Stockholm (HedgeFonder.nu) – Den fristående fondförvaltaren Coeli lanserar en ny hedgefond-i-fond kallad Coeli Select Multihedge. Coeli Select är en multistrategifond som investerar i hedgefonder som förvaltas av fondbolag inom Coeli. I och med detta vill man ge hedgefondgiganten i Sverige – Brummer & Partners – en match om titeln ”bästa fond” inom multistrategisegmentet.

Coeli Asset Management har bedrivit kapitalförvaltning i egen regi sedan 2001. Förvaltningen sträcker sig över samtliga tillgångsklasser med fokus på värdebevarande och riskallokering och erbjuder investeringar i hedgefonder, aktier, räntor och private equity. Idag förvaltar man ca 7 miljarder kronor inom multi- och singelstrategier.
I den nya multistrategifonden analyserar och utvärderar Coelis förvaltare kontinuerligt de underliggande fonderna och de individuella förvaltarteamen och kan allokera aktivt mellan dem. Man ställer tydliga krav för att säkerställa kvaliteten på de underliggande fonderna och varje fond måste bidra med fem grundläggande egenskaper:

1. Unik strategi – Fondens strategi och risk ska vara unik och därmed okorrelerad i förhållande till de andra fonderna i Coeli Select Multihedge
2. Marknadsoberoende – Fonden får inte ha systematisk marknadsrisk, dvs den ska kunna skapa avkastning oavsett hur aktier, räntor, råvaror och andra traditionella tillgångsslag rör sig
3. Likviditet – Fondens underliggande marknad ska vara så pass likvid att andelsägarna kan erbjudas daglig likviditet
4. Högavkastande – Fondens förväntade årliga avkastning skall överstiga 10%
5. Svenska kronor – Fonden ska handlas i svenska kronor för att minimera valutarisken

Det största ackumulerade värdefallet för Coeli Select Multihedge är -4,56%, hela detta värdefall var återtaget tre månader senare. För SIX PRX samt HFRI är de största ackumulerade värdefallen -44,42% respektive -21,37%.
Samtliga underliggande fonder har lägre volatilitet än aktiemarknaden. Detta i kombination med en låg korrelationen mellan fonderna bidrar till att hålla nere den totala risken.

Den genomsnittliga standardavvikelsen sedan start har varit 7,32%. SIX PRX har under samma period haft en standardavvikelse på 22,5%. Hittills i år har strategin gett 3,31% avkastning och 2011 ett marginellt minus på -0,4%.
Det är i dagsläget tre fonder som ingår: Spektrum, Norrsken och Coeli Power.
Spektrum är en CTA/Managed Futures-fond som bedriver modellbaserad förvaltning, fördelad över flera marknader och tillgångsslag med absolutavkastning som mål. Fonden handlar i aktieindex, valutor, räntor och råvaror och har en genomsnittlig årsavkastning om 9,43 % sedan start med en standardavvikelse på 12,27%.
Norrsken är en händelsestyrd, eller så kallad event driven, aktieorienterad hedgefond med en marknadsneutral inriktning, där förvaltarna fokuserar på publika bolag vid större förändringar i bolagets ägarskap. Den genomsnittliga årsavkastningen har varit 6,32% sedan start med en standardavvikelse på 5,95 %.
Coeli Power har en trendföljande strategi på den nordiska elmarknaden med absolutavkastning som mål och sköts av ett erfaret förvaltarteam med 15 års track-record utan något år med negativ avkastning. Den genomsnittliga årsavkastningen uppgår till 10,74 % sedan start med en standardavvikelse på 13,87 %. Dock är resultatet för innevarande år ett minus på -4% per sista juli – en nedgång som fortsatt hittills under augusti.
Coeli Select Multihedge finns även i en belånad variant med 2x hävstång.

Bild: (c) shutterstock—alex saberi