

Kvant-förvaltare summerar den värsta månaden sedan 2007

Stockholm (HedgeFonder.nu) - Kvantitativa hedgefonder kommer att rapportera det sämsta månatliga resultatet för oktober sedan 2007, på grund av många samverkande faktorer med negativ utgång.

Managed futures- och råvaruförvaltares försöker att, med hjälp av komplicerade algoritmer, upptäcka och utnyttja marknadstrender - men den senaste månaden har många av dessa trender vänt sig emot dem. Det rapporterar FINalternatives.

Enligt Newedge CTA Trend Sub-Index var den genomsnittliga trendföljande fonden ner -5,63% föregående månad, per den 25/10. Om inget ändrades under de sista fem dagarna, kommer de att tvingas rapportera den sämsta månadssiffran sedan augusti 2007 (trots det är CTA-strategier i genomsnitt +/- 0 hittills i år).

Alex Greyserman, Chief Investment Officers på ISAM fund med 900 mUSD under förvaltning, som var ner ca -5% hittills under månaden, berättar för Reuters att det inte fanns någon enskild makrofaktor att skylla på:

“Statistiskt sett så kan sådana här saker hända, men de borde inte inträffa särskilt ofta. Det har bara varit en av dessa månader när alla positioner gick emot dig överallt av en massa olika anledningar”.

Även de lysande stjärnorna inom den kvantdrivna fondvärlden får kämpa - Winton Capital, med ett förvaltad kapital på 29 miljarder USD, låg på -6.5% hittills i år per den 26 oktober och Man Group's flaggskeppsfond inom AHL på 16,3 mdr USD, är ner -4% för helåret. En annan gigant, BlueCrest Capital har gått så långt som att förändra de program och system man använder för att handla inom en av sina datoriserade fonder.

Bild: (c) shutterstock—alex saberi