

Brummer & Partners summerar 2012

Stockholm (HedgeFonder.nu) - Brummer & Partners, Sveriges största hedgefondgrupp, kan blicka tillbaka på 2012 och konstatera att det framgångsrika konceptet med ett brett spektrum av fonder fortfarande får anses lyckosamt.

Helåret gav positiv avkastning för fem av åtta singelstrategifonder, därtill landade även hedgefond-fonden Brummer Multi Strategy följaktligen också på plus med en uppgång på 4,4%.

Vinnarna bland singelstrategierna var kreditfonden Observatory (dec +1,5%, 2012 +14,2%) och trotjänaren Zenit (dec +0,4%, 2012 +13,2%) som efter förvaltarbytet tidigare har fortsatt att ånga på. Även macrofonden Nektar levererade närmare sitt historiska snitt i och med en uppgång på +8,0% för 2012 och +1,1% under december.

Den framgångsrika tech-fonden Manticore, med sitt numera helamerikanska förvaltarteam, summerade uppgången för helåret till +7,5% (dec -0,6%). Sedan avvecklingen av det svenska teamet har fonden haft mycket goda förvaltningsresultat.

Den marknadsneutrala fonden Archipel har en ambition att ha en låg risk i portföljen och bara leverera "alfa", utan att exponera sig mot marknadsrisken. Standardavvikelsen för året blev 5,16%, vilket är en knapp tredjedel av MSCI World-index. Avkastningen för året blev +3,9% (dec -0,3%).

Den tidigare högpresteraren Lynx, som är en CTA/Managed Futures-fond baserad på datoriserade algoritmer i sin förvaltning, hade ett mer besvärligt år med hög volatilitet i nivå med aktiemarknaden. December månads resultat skrevs till -1,0%, vilket gjorde att helårsresultatet för 2012 landade på -5,2% ets..

Teamet som anslöt från Goldman Sachs och startade den händelsestyrda fonden Benros inom Brummer, har fått en tuff start i den nya miljön och stängde året på minus (dec +0,3%, 2012 -5,6% est.). Återstår att se om de lyckas vända utvecklingen under 2013.

Aktiehedgefonden Futuris hade också ett mörkare år under 2012. Historiskt har fonden en genomsnittlig avkastning på goda +14,5% per år sedan start. Dock lyckades man inte upprepa den bedriften, utan stängde året på -7,8% (dec -0,8%).

I november 2012 startade de tidigare Zenit-förvaltarna den nya relative value-fonden Carve inom Brummer & Partners paraply. Med ett startkapital på mer än 3 miljarder SEK bör det ha varit en av de största lanseringarna under året. Resultatet för fondens första två månader uppgår till +0,43%.

Bild: (c) shutterstock—RexRover