Stark start för Sector Sigma Nordic

Stockholm (HedgeNordic.com) – Den norska förvaltarfirman Sector Asset Management, grundad 1999, är Norges största oberoende hedgefondförvaltare, med cirka 1 mdr USD i tillgångar under förvaltning. Nytillskottet Sector Sigma Nordic, som startade 25 juni 2012 efter att Sector förvärvat Sigma (A class), har fått en flygande start och stängde helåret 2013 på +25,2%. Och detta levererat med låg risk.

Sector Asset Management har fem oberoende team som förvaltar portföljer inom Energi, Hälsosektorn, samt japanska, globala och nordiska aktier. Det nordiska teamet består av Jannik Arvesen (CIO), Jan Gabrielsen och Björn Tore Urdal. Tillsammans ansvarar de för förvaltningen av Sector Sigma Nordic, en lång/kort aktiehedgefond, fokuserad – som namnet antyder – på den nordiska aktiemarknaden.

Fonden, som är UCITS IV-klassad, har cirka 40 aktier i portföljen med en lång bias och en målsättning att ha en volatilitet på 10-15%, motsvarande ungefär halva den nordiska aktiemarknadens volatilitet historiskt. Hittills har man dock legat på en standardavvikelse om endast 6,74%. Beta jämfört med nordiska aktieindexet VINX 30 är låga 0,24 och Sharpe-kvoten är lysande 2,13. Den genomsnittliga nettoexponeringen har varit 53,6%. Under 2013 hade man endast en månad med negativ avkastning (mars, -0,9%). Aktierna väljs ur ett möjligt investeringsunivers om cirka 250 aktier, av totalt ungefär 700 noterade bolag inom Norden.

Förvaltarna menar att möjligheterna inom den nordiska aktiemarknaden är attraktiva. Långa strukturella trender och ett beteende på marknaden tydligt kopplat till konjunkturcykeln, skapar gynnsamma tillfällen lämpat för ett lång/kort-mandat. Fondens investeringsstrategi är enligt förvaltarna ”skräddarsydd för den nordiska aktiemarknaden”, vilket man hävdar i sin presentation.

Avgiften uppgår till 1,5% i fast avgift samt 20% på överavkastningen i prestationsbaserat arvode. Fonden har daglig likviditet och har andelsklasser i EUR, USD, NOK och SEK.

Bild: (c) lily—Fotolia.com