

IPM Systematic Macro Fund - september svag månad

Stockholm (HedgeNordic.com) - Den Stockholmsbaserade hedgefondförvaltaren Informed Portfolio Management - IPM - är en riktig doldis på den svenska marknaden. Trots att IPM förvaltar ca 7 miljarder USD (motsvarande ca 50 mdr SEK) - är det inte många utanför de riktigt insatta som känner till något om denna jätteförvaltare.

IPM är en systematisk makro- och aktieförvaltare som är analysdriven och fundamental och som med hjälp av och med kvantitativa modeller selekterar ut de finansiella instrument som sedan väljs för investeringar.

IPM Systematic Macro Fund hade en smärre nedgång i september, en månad då riskviljan generellt sett föll tillbaka till följd av flera händelser - allt ifrån PIMCOs Bill Gross, som lämnade giganten inom ränteförvaltning med stora marknadsrörelser som följd, till spekulationerna kring ECBs kommande stimulanser pga låg tillväxt. Det skriver förvaltaren i sitt månadsbrev för september.

Bland de större rörelserna var den globala nedgången för aktier, samt den tydliga förstärkningen av USD. Förlusterna var relativt koncentrerade till valutorna inom de utvecklade länderna, vilka verkligen gynnades av USD-förstärkningen och den försvagade JPY. Fonden led dock av sin långa position i NZD, som föll efter kommentarer från de Nya Zeeländska ledarna om att valutan var kraftfullt övervärderad.

Emerging Markets-valutorna i portföljen drabbades av sin första negativa månad hittills i år.

Nedgången blev -0,53% i september, respektive +12,53% hittills i år, till en standardavvikelse på 10,8 för fonden.

Bild: (c) isak55—shutterstock.com