



FOR IMMEDIATE RELEASE

Contacts:

HFR

Kenneth Heinz
Chicago/312.658.0955
info@hfr.com [@HFRInc](https://twitter.com/HFRInc)
[@KennethJHeinz](https://twitter.com/KennethJHeinz)

MacMillan Communications

Chris Sullivan
New York/212.473.4442
chris@macmillancom.com

Hydra Strategy

Henrietta Hirst
London/+44 (0) 7880 742 375
henrietta.hirst@hydrastrategy.co.uk

HFRI は強い 2021 年を締結する

**株式ヘッジ、11 月の下落のイベント主導リード反転;
暗号、商品、アクティビスト、エネルギーと利回り選択肢は、21 のために利益を
導きます;
インフレーション、金利、ウイルス、そして、22 への潜在的トップ露出テーマ**

シカゴ、(2022 年 1 月 7 日)-ヘッジファンドは、金利とインフレの上昇という 2 つの課題と、2 年目の影響を乗り越えたため、不確実性と高いボラティリティに支配された強い年を締めくくるために 12 月に進みました。世界的なコロナウイルスのパンデミック。確立されたグローバルリーダーである HFR®が本日発表したデータによると、投資可能な HFRI500 ファンド加重総合指数は 12 月に+ 0.9%上昇し、前月の下落を逆転させました。一方、HFR ファンド加重総合指数®(FWC)は+ 1.3%上昇しました。世界のヘッジファンド業界のインデックス作成、分析、調査において。

2021 年通年で、HFRI FWC は+10.3 を獲得し、前年の+ 11.8%の上昇をわずかに下回りましたが、2009 年以来 3 番目に高い暦年のパフォーマンスを記録しました。

暗号通貨に投資するファンドは、2021 年にすべてのヘッジファンドをリードするために再び急上昇し、HFR 暗号資産指数は+ 215%急上昇し、2020 年のリターン+ 193%を上回りました。

基礎となる HFRI インデックス構成要素のパフォーマンスのばらつきは、12 月に縮小し、HFRI の上位 10 分の 1 は平均+ 6.6%増加しましたが、下位十分位数は 1 か月で平均-3.5%減少し、上下のばらつきを表しています。11 月の 19.1 パーセントの上下の分散と比較して、その月の 10.1 パーセントの。2021 年通年で、HFRI の上位の十分位数は平均+ 45.6%急上昇し、下位の十分位数は平均-12.3%減少しました。

専門のサブストラテジー全体に長期および短期投資を行うエクイティヘッジファンドは、12月に業界戦略の上昇を主導し、前月の減少を逆転させました。オミクロンコロナウイルス変異体の蔓延。投資可能な HFRI500 株式ヘッジ指数はその月に+ 1.7%上昇し、2021 年通年のパフォーマンスは+ 11.9%になりました。一方、HFRI 株式ヘッジ(トータル)指数は、ヘルスケアおよびファンダメンタルバリューのエクスポージャーの増加に牽引されて、+ 1.85%上昇しました。HFRI 株式ヘッジ:ヘルスケア指数は+ 3.9%急上昇しましたが、HFRI 株式ヘッジ:ファンダメンタル・バリュー指数はその月に+ 2.4%上昇しました。2021 年通年の EH パフォーマンスは、HFRI 株式ヘッジ:エネルギー/素材指数+ 26.2%上昇したことで主導されました。

イベントドリブン戦略は、多くの場合、不利で価値の高いエクイティエクスポージャーと M&A 状況に関する憶測に焦点を当てており、アクティビスト戦略とスペシャルシチュエーション戦略によって 12月に獲得されました。投資可能な HFRI500 イベントドリブン指数は+ 1.3%上昇し、HFRI イベントドリブン(合計)指数はその月に+ 1.8%上昇し、2021 年通年のパフォーマンスは+ 13.1%となり、2009 年以来の最高のパフォーマンスとなりました。戦略の上昇は、12月に+ 5.1%上昇した HFRI イベントドリブン:アクティビスト指数と+ 2.6%上昇した HFRI イベントドリブン:スペシャルシチュエーション指数に牽引され、どちらも前月の低下を逆転させました。2021 年通年では、ED のパフォーマンスは HFRI イベントドリブン:アクティビスト指数が主導し、+ 18.8%上昇しました。

金利が上昇し、マネージャーが米連邦準備制度理事会による債券購入の短期的な漸減に向けてポジションを継続したため、債券ベースの金利に敏感な戦略も今月も進んだ。投資可能な HFRI500 レラティブバリュー指数はその月に+ 0.2%上昇しましたが、HFRI レラティブバリュー(トータル)指数は+ 0.3%上昇しました。サブストラテジーの上昇は、HFRI レラティブバリュー:イールドオルタナティブ指数(+ 2.4%上昇)と HFRI レラティブバリュー:ボラティリティ指数(+ 1.4%上昇)が主導し、どちらも前月の低下を逆転させました。2021 年通年では、RVA のパフォーマンスは HFRI レラティブバリュー:イールドオルタナティブ指数が主導し、+ 30.9%を返しました。

金利が上昇し続けている間に商品が増加し、HFRI マクロ(トータル)指数が+ 0.65%上昇した一方で、投資可能な HFRI 500 マクロ指数は月間で-0.05%のわずかな下落を記録したため、マクロ戦略も月に進みました。マクロサブストラテジーの上昇は、12月に+ 2.9%急上昇した HFRI マクロ:マルチ戦略指数によって牽引されました。2021 年通年では、マクロサブ戦略のパフォーマンスは HFRI マクロ:コモディティ指数によって主導され、+ 23.6%急上昇しました。

リスクプレミアム戦略もまた、12月下旬にセンチメントのリスクが戻ったため、前月の低下を逆転させました。この月の HFR バンク・システムティック・リスクプレミアム・クレジット・株式ヘッジ指数は+

4.57%急上昇しました。2021年通年のリスクプレミアムのパフォーマンスは、+27.4%急上昇したHFRバンク・システマティック・リスクプレミアム・コモディティ指数に牽引されました。HFRX市場の方向性指数は12月に+1.6%急上昇し、2021年のすべてのHFRX指数を+13.65%上昇させました。HFRX株式ヘッジ指数は2021年の戦略パフォーマンスを主導し、年間で+12.1%上昇しました。

HFRI多様性指数は12月に+1.9%上昇し、HFRI女性指数は+0.5%上昇しました。


「エクイティヘッジ、イベントドリブン、商品のハイベータ戦略に主導されたヘッジファンドは、2021年を12月に力強いパフォーマンスで締めくくり、2年間の堅調な期間を締めくくり、コロナウイルスのパンデミックの開始以来、極端なボラティリティと市場サイクルの混乱をうまく乗り越えました。ヘッジファンド業界全体が4兆ドルを超えたため、世界的な検疫が行われました」とHFRの社長であるケネスJ.ハインツは述べています。「世界的大流行の発生による歴史的な株式市場の崩壊を含めて、株式に焦点を当てたヘッジファンド戦略は、米国の株式(DJIAに代表される)を200ベースポイント以上上回り、3分の1の差でそれを達成しました。ボラティリティ。2022年まで、ヘッジファンドマネージャーは世界的なパンデミックに関連する継続的なボラティリティを位置付けていますが、金利上昇と記録的なインフレの強力なダイナミクスを考慮して、株式、債券、商品市場全体の資本保全にも戦術的に焦点を当てています。過去2年間にわたって戦略の堅牢性を実証してきたマネージャーは、新年を通じて業界のパフォーマンスと成長をリードし続ける可能性があります。」

HFR Indices are ESMA registered.

For more information from HFR:

Visit www.HFR.com

Follow HFR on Weibo: [@HFRAsia](#)

 Follow HFR on Twitter: [@HFRInc](#)

 Follow Ken Heinz on Twitter: [@KennethJHeinz](#)

About HFR®

HFR is the global leader in the alternative investment industry, specializing in the indexation and analysis of hedge funds. Established in 1992, HFR produces the HFRI, HFRX and HFRU Indices, the industry's most widely used benchmarks of global hedge fund performance. HFR calculates over 100 indices of hedge fund performance ranging from industry-aggregate levels down to specific, niche areas of sub-strategy and regional investment focus. HFR Database, a comprehensive resource available for hedge fund investors, includes fund-level detail on historical performance and assets, as well as firm characteristics on both the broadest and most influential hedge fund managers. HFR has developed a detailed fund classification system, enabling granular and specific queries for relative performance measurement, peer group analysis and benchmarking. The HFR suite of analysis products leverages HFR Database to provide detailed, current, comprehensive, and relevant aggregate reference points on all facets of the hedge fund industry. HFR also offers consulting services for clients seeking customized top-level or more sophisticated analysis. For the hedge fund industry's leading investors and hedge fund managers, **HFR is The Institutional Standard.**

###