



VOOR ONMIDDELLIJKE PUBLICATIE

Contactpersonen:

HFR

Kenneth Heinz
Chicago/312.658.0955

info@hfr.com  @HFRInc
@KennethJHeinz

Craft & Capital

Chris Sullivan
New York/212.473.4442

chris@craftandcapital.com

Hydra Strategy

Henrietta Hirst
Londen/+44 (0) 7880 742 375

henrietta.hirst@hydrastrategy.co.uk

HFR LANCEERT BELEGBARE INDEXFAMILIE HFRI 400 (US)

De indexen bestaan uit particuliere hedgefondsen die openstaan voor in de VS belastingplichtige beleggers met een groot en ultragroot eigen vermogen

CHICAGO, (9 maart 2023) - Vandaag lanceerde HFR de HFRI 400 (US) Indices, een eerste index in zijn soort bestaande uit particuliere hedgefondsen die openstaan voor in de VS belastingplichtige beleggers. Hierdoor wordt de HFRI 400 een geschikte benchmark voor Amerikaanse belastingplichtige beleggers met een groot en ultragroot eigen vermogen.

De HFRI 400 (US) Fund Weighted Composite Index noteerde in februari een krappe daling van -0,3 procent (geschat), dit na een winst van +2,3 procent in januari en waardoor het YTD rendement op +2,0 procent uitkomt. De strategieprestaties van de HFRI 400, die een sterke outperformance vertoonden ten opzichte van de dalende aandelenmarkten, werden aangevoerd door Event Driven en Macrostrategieën. Event-driven strategieën, die zich vaak richten op out-of-favor, deep value equity exposures en speculatie op M&A-situaties, leidden in februari de strategieprestaties met de belegbare HFRI 400 (US) Event-Driven Index die +0,64 procent steeg; de prestaties van ED-substrategieën werden aangevoerd door de HFRI 400 (US) ED: Special Situations Index, die tijdens de maand +1,7 procent steeg. Ook niet-gecorrleerde macrostrategieën gingen er in februari op vooruit, met een maandrendement van +0,56 procent voor de HFRI 400 (US) Macro Index; de prestaties van de macro-substrategieën werden aangevoerd door de HFRI 400 (US) Macro: Currency Index, die +1,9 procent toenam.

Relative Value Arbitrage en Equity Hedge-strategieën leverden in februari gemengde resultaten op, waarbij ook de dalingen op de aandelenmarkten werden overtroffen. De HFRI 400 (US) Relative

Value Index daalde -0,2 procent (geschat). De prestaties werden geleid door de HFRI 400 (US) RV: FI-Sovereign Index, die +0,7 procent toenam. De HFRI 400 (US) Equity Hedge Index daalde tijdens de maand -1,3 procent, waarbij de prestaties van de sub-strategieën werden aangevoerd door de HFRI 400 (US) EH: Quantitative Directional Index, die +2,15 procent toenam.

“Dankzij de dynamische, robuuste posities en positionering door hedgefondsen konden toekomstgerichte instellingen effectief navigeren door de recente volatiliteit van de financiële markten en de historische verstoring van correlaties tussen aandelen en obligaties waarop belangrijke institutionele kapitaaltoewijzingen zijn gebaseerd. Met de lancering van de HFRI 400 beschikken Amerikaanse particuliere beleggers met een groot en ultragroot eigen vermogen nu over een solide benchmark voor hedgefondsprestaties, die een afspiegeling vormt van de HFRI 500 Index voor offshore beleggers en instellingen”, aldus Kenneth J. Heinz, president van HFR.

De lancering van vandaag volgt op de succesvolle lancering van de HFRI 500 indexfamilie voor belegbare hedgefondsen; de HFRI 400 (US) Indices maken gebruik van een vergelijkbare belegbare methodologie en constructie als de HFRI 500 Indices, die geschikt zijn voor de exploitatie van door HFR gelicentieerde trackerfondsproducten. HFR voert actief strategische gesprekken met een aantal financiële instellingen over de belangstelling in licentiering van de HFRI 400 (US) Indices voor de exploitatie van trackerfondsen.

"Hedgefondsen en sectorale posities hebben zich in februari aangepast aan de verslechterende macro-economische omstandigheden, met winsten in Macro- en Event Driven-strategieën, aangevuld met gemengde prestaties van substrategieën in vastrentende Relative Value en geselecteerde Equity Hedge posities met lage bèta," voegde Heinz eraan toe. "Net zoals in 2022 vertoonden hedgefondsen in februari een sterke, defensieve outperformance ten opzichte van de dalingen op de aandelenmarkten, gedreven door winsten in kwantitatieve, trendvolgende Macro, toen de financiële markten een scherpe omslag kenden van het risk-on sentiment van januari en beleggers zich positioneerden voor een voortzetting van de trends van generatie-inflatie, hogere rente en economische onzekerheid."


OPMERKING: De indexcijfers van februari 2023 zijn geschat op 7 maart 2023

HFR Indexen zijn ESMA-geregistreerd.

Voor meer informatie van HFR:

Bezoek www.HFR.com

Volg HFR op Weibo: [@HFRAsia](#)

 Volg HFR op Twitter: [@HFRInc](#)

 Volg Ken Heinz op Twitter: [@KennethJHeinz](#)

Over HFR®

HFR is wereldleider in de alternatieve beleggingsindustrie, gespecialiseerd in de indexering en analyse van hedgefondsen. HFR, opgericht in 1992, produceert de HFRI, HFRX en HFRU Indices, de meest gebruikte benchmarks voor de prestaties van hedgefondsen wereldwijd. HFR analyseert de prestaties van meer dan 100 indexen van hedgefondsen; variërend van het algemene niveau van de sector tot specifieke niches van deelstrategie- en een regionale beleggingsfocus. HFR Database, een uitgebreide bron voor hedgefondsbeleggers, bevat gedetailleerde gegevens op fondsniveau over historische prestaties en activa, alsmede bedrijfskenmerken over zowel de meest brede als de meest invloedrijke hedgefondsbeheerders. HFR heeft een gedetailleerd fondsclassificatiesysteem ontwikkeld waardoor verfijnde en specifieke zoekacties mogelijk zijn voor relatieve rendementsmetingen, peer group-analyse en benchmarking. De HFR-reeks van analyseproducten maakt gebruik van de HFR Database om gedetailleerde, actuele, uitgebreide en relevante samengestelde referentiepunten te bieden voor alle facetten van de hedgefondssector. HFR biedt ook adviesdiensten aan voor klanten die op zoek zijn naar topniveau of meer verfijnde analyses. Voor de belangrijkste beleggers en beheerders van hedgefondsen in de sector is **HFR De Institutionele Standaard**.

###