



FREI ZUR SOFORTIGEN VERÖFFENTLICHUNG

Kontakte:

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@hydrastategy.co.uk

HFR LANCIERT HFRI 400 (US) INDEXFAMILIE

Die Indizes bestehen aus privaten Hedgefonds, zugänglich für U.S. steuerpflichtige vermögende und sehr vermögende Investoren

CHICAGO, (9. März 2023) - HFR hat heute die HFRI 400 (US) Indizes lanciert, einen ersten Index seiner Art, der sich aus privaten Hedgefonds zusammensetzt, die für steuerpflichtige US-Investoren zugänglich sind, was den HFRI 400 zu einer geeigneten Benchmark für steuerpflichtige vermögende und sehr vermögende Investoren mit Sitz in den USA macht.

Der HFRI 400 (US) Fund Weighted Composite Index verzeichnete im Februar einen leichten Rückgang von -0,3 Prozent (geschätzt), nachdem er im Januar um +2,3 Prozent zugelegt hatte und die Jahresrendite auf +2,0 Prozent sank. Die Performance der HFRI 400-Strategien übertraf in diesem Monat die Rückgänge am Aktienmarkt deutlich und wurde von Event-Driven- und Makro-Strategien angeführt. Event-Driven-Strategien, die sich oft auf Out-of-Favor, Deep-Value-Aktienengagements und Spekulationen auf Fusionen und Übernahmen konzentrieren, führten die Strategie-Performance im Februar an, wobei der investierbare HFRI 400 (US) Event-Driven Index um +0,64 Prozent zulegte; die Performance der ED-Substrategie wurde vom HFRI 400 (US) ED: Special Situations Index angeführt, der im Februar um +1,7 Prozent zulegte. Auch die unkorrelierten Makro-Strategien legten im Februar zu: Der investierbare HFRI 400 (US) Macro Index erzielte im Februar eine Rendite von +0,56 Prozent; die Performance der Makro-Substrategien wurde vom HFRI 400 (US) Macro: Currency Index angeführt, der um +1,9 Prozent zulegte.

Die Relative-Value-Arbitrage- und Equity-Hedge-Strategien erzielten im Februar eine gemischte Performance und übertrafen ebenfalls die Rückgänge an den Aktienmärkten. Der HFRI 400 (US) Relative Value Index sank um -0,2 Prozent (geschätzt), wobei die Performance vom HFRI 400 (US) RV: FI-Sovereign Index angeführt wurde, der um +0,7 Prozent zulegte. Der HFRI 400 (US) Equity Hedge Index ging im Monatsverlauf um -1,3 Prozent zurück, wobei die Performance der Teilstrategien vom HFRI 400 (US) EH: Quantitative Directional Index angeführt wurde, der um +2,15 Prozent zulegte.

“Dynamische, robuste Engagements und Positionierungen von Hedgefonds haben es vorausschauenden Institutionen ermöglicht, die jüngste Volatilität der Finanzmärkte und den historischen Zusammenbruch der Korrelationen zwischen Aktien und Anleihen, auf denen bedeutende institutionelle Kapitalallokationen beruhen, effektiv zu bewältigen. Mit der Einführung des HFRI 400 haben US-amerikanische Privatanleger, vermögende und sehr vermögende Anleger nun eine solide investierbare Benchmark für die Performance von Hedgefonds, die die des HFRI 500 Index für Offshore-Investoren und Institutionen widerspiegelt”, so Kenneth J. Heinz, Präsident von HFR.

Die heutige Markteinführung folgt auf die erfolgreiche Einführung der investierbaren HFRI 500 Hedgefonds-Indexfamilie; die HFRI 400 (US) Indizes verwenden eine ähnliche investierbare Methodik und Konstruktion wie die HFRI 500 Indizes und eignen sich für die Funktionsweise von HFR-lizenzierten, nachverfolgenden Fondsprodukten. HFR ist aktiv in strategischen Gesprächen mit einer Reihe von Finanzinstituten, die Interesse an einer Lizenzierung der HFRI 400 (US) Indizes für Tracking-Fonds haben.

“Hedgefonds und Branchenengagements passten sich im Februar an die sich verschlechternden makroökonomischen Bedingungen an, wobei Zuwächse bei Makro- und Event-Driven-Strategien durch eine gemischte Performance bei festverzinslichen Relative-Value-Strategien und ausgewählten Equity-Hedge-Engagements mit niedrigem Beta ergänzt wurden”, so Heinz weiter. “Ähnlich wie im Jahr 2022 zeigten Hedgefonds im Februar eine starke, defensive Outperformance gegenüber Rückgängen auf den Aktienmärkten, angetrieben von Gewinnen bei quantitativen, trendfolgenden Macro-Strategien, da die Finanzmärkte eine starke Umkehrung der risikofreudigen Stimmung vom Januar erlebten und die Anleger sich auf eine Fortsetzung der Trends von generationenübergreifender Inflation, höheren Zinssätzen und wirtschaftlicher Unsicherheit einstellten.”

HINWEIS: Die Performancezahlen des Index für Februar 2023 sind Schätzungen vom 7. März 2023.

Die HFR-Indizes sind bei der ESMA registriert.

Für weitere Informationen zu HFR:

Visit www.HFR.com

Follow HFR on Weibo: @HFRAsia

 Follow HFR on Twitter: @HFRInc

 Follow Ken Heinz on Twitter: @KennethJHeinz

Über HFR®

HFR ist weltweit führend in der alternativen Investmentbranche und spezialisiert auf die Indexierung und Analyse von Hedgefonds. HFR wurde 1992 gegründet und erstellt die HFRI-, HFRX- und HFRU-Indizes, die in der Branche am häufigsten verwendeten Benchmarks für die globale Hedgefonds-Performance. HFR berechnet über 100 Indizes für die Performance von Hedgefonds, die von der Gesamtbranche bis hin zu spezifischen Nischenbereichen mit Teilstrategien und regionalen Investitionsschwerpunkten reichen. Die HFR-Datenbank, eine umfassende Ressource für Hedge-Fonds-Investoren, enthält auf Fondsebene detaillierte Angaben zur historischen Performance und zu den Vermögenswerten sowie zu den Firmenmerkmalen der größten und einflussreichsten Hedge-Fonds-Manager. HFR hat ein detailliertes Fondsklassifizierungssystem entwickelt, das granulare und spezifische Abfragen für die relative Performancemessung, Peer-Group-Analysen und Benchmarking ermöglicht. Die HFR-Analyseprodukte nutzen die HFR-Datenbank, um detaillierte, aktuelle, umfassende und relevante aggregierte Referenzpunkte zu allen Facetten der Hedgefonds-Branche zu liefern. HFR bietet auch Beratungsdienste für Kunden an, die maßgeschneiderte Top-Level- oder komplexere Analysen wünschen. Für die führenden Investoren und Hedge-Fonds-Manager der Hedge-Fonds-Branche **ist der HFR der institutionelle Standard.**

###