

オルタナティブ投資情報

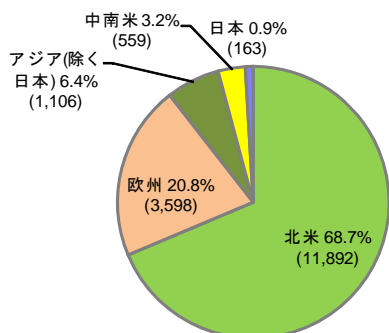
▶ ヘッジファンドの資金動向：

投資地域別にみたヘッジファンドの運用残高、運用損益による増減、資金の純流出入についての動向は以下の通りである（データはユーリカヘッジの推計である）。

当月（2012年6月）末のヘッジファンド全体の運用残高は、前月末より82億ドル減少し、1兆7,318億ドルと推計される（図表1）。当月は、欧州、中南米、日本において純流出となり、運用損益は日本を除く全地域でマイナスとなった。

図表1 ヘッジファンドの投資地域別運用残高と資金フロー

(a) 2012年6月末の運用残高の地域別比率(括弧内は億ドル)



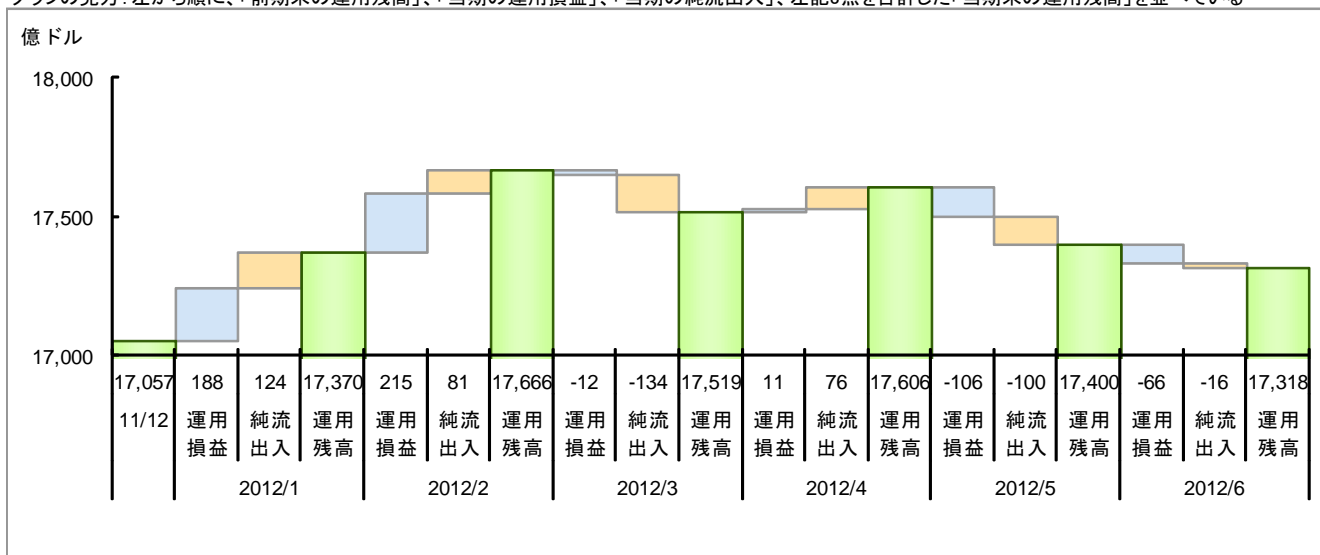
(出所)ユーリカヘッジよりNFI作成

(b) 運用残高、運用損益、純流出入(億ドル)

投資地域	6月末 運用残高 a + b + c	5月末 運用残高 a	6月中 運用損益 b	6月中 純流出入 c	運用損益+ 純流出入 b + c
北米	11,892	11,934	-49	7	-42
欧州	3,598	3,625	-14	-14	-28
アジア(除く日本)	1,106	1,107	-4	3	-1
中南米	559	567	-1	-7	-8
日本	163	167	1	-5	-4
全体	17,318	17,400	-66	-16	-82

図表2 ヘッジファンド全体の運用残高と資金フロー

グラフの見方: 左から順に、「前期末の運用残高」、「当期の運用損益」、「当期の純流出入」、左記3点を合計した「当期末の運用残高」を並べている



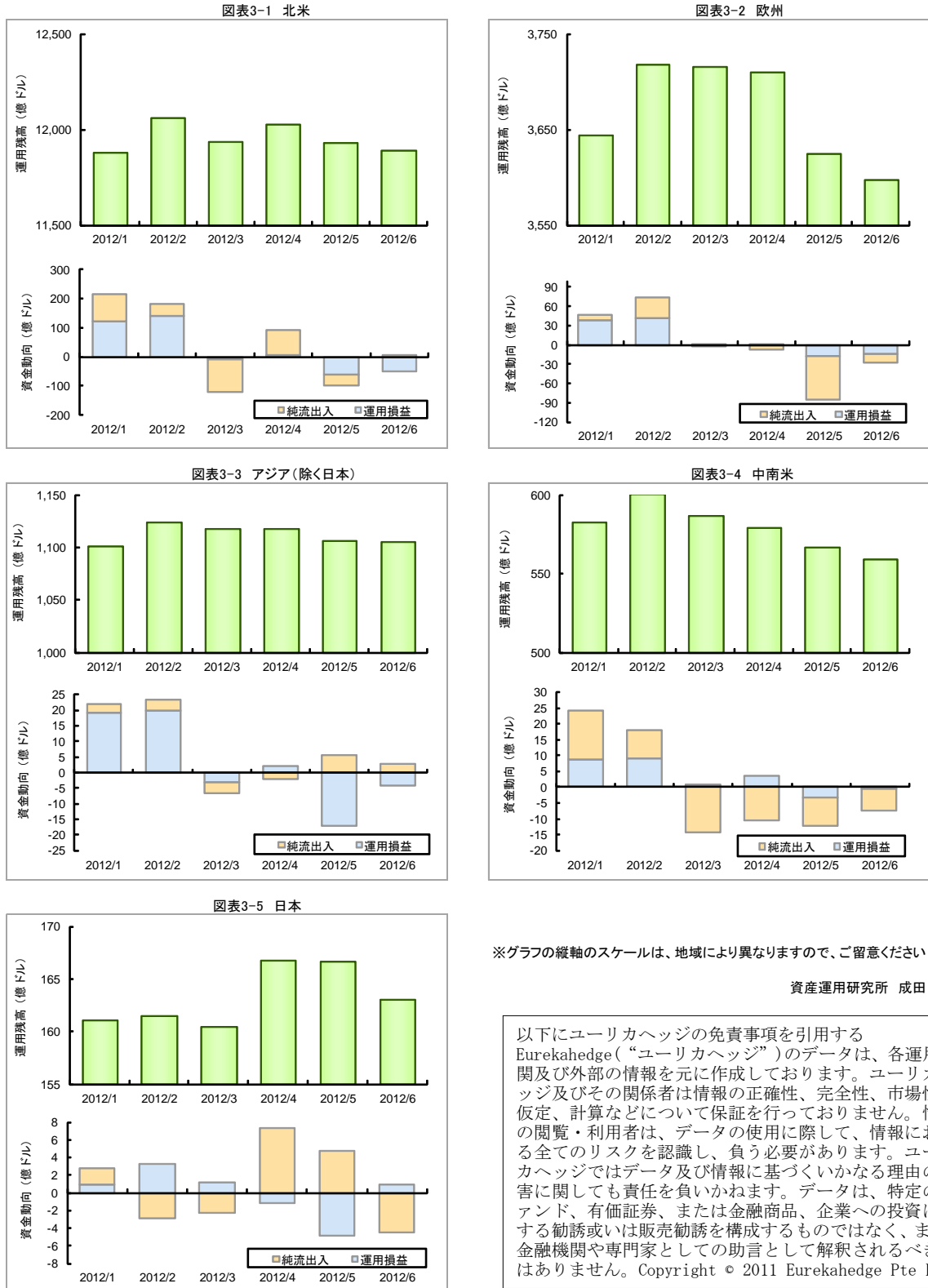
(出所)ユーリカヘッジよりNFI作成

(参考)ユーリカヘッジ・ヘッジファンド指数の騰落率※1, 2

2012/1	2012/2	2012/3	2012/4	2012/5	2012/6
2.22%	1.91%	-0.34%	-0.41%	-1.82%	-0.06%

※1: ユーリカヘッジのヘッジファンド指数は単純平均で算出されている
※2: データ取得日は2012年7月26日

図表3 ヘッジファンドの投資地域別資金動向



※グラフの縦軸のスケールは、地域により異なりますので、ご注意ください

資産運用研究所 成田

以下にユーリカヘッジの免責事項を引用する
Eurekahedge (“ユーリカヘッジ”)のデータは、各運用機関及び外部の情報を元に作成しております。ユーリカヘッジ及びその関係者は情報の正確性、完全性、市場性、仮定、計算などについて保証を行っておりません。情報の閲覧・利用者は、データの使用に際して、情報における全てのリスクを認識し、負う必要があります。ユーリカヘッジではデータ及び情報に基づくいかなる理由の損害に関しても責任を負いかねます。データは、特定のファンド、有価証券、または金融商品、企業への投資に関する勧誘或いは販売勧誘を構成するものではなく、また、金融機関や専門家としての助言として解釈されるべきではありません。Copyright © 2011 Eurekahedge Pte Ltd