



Stockholm, 7 juni 2022

Brummer Multi-Strategy – portföljuppdatering

Read this news in English [here](#).

Brummer Multi-Strategy (BMS) mål är att generera god riskjusterad avkastning oavsett marknadsmiljö. BMS:s förvaltarteam arbetar kontinuerligt med att förbättra portföljens risk/avkastningsprofil. Det sker genom att identifiera och utvärdera nya investeringsstrategier, utvärdera befintliga strategier och aktivt allokera mellan dem. I denna process har två nya strategier adderats under året och ytterligare en strategi kommer att lanseras under det fjärde kvartalet. Därtill har portföljförvaltarna beslutat att lösa in hela innehavet i den diskretonära makrostrategin Arete.

Sedan den 1 maj investerar BMS i en ny marknadsneutral strategi med fokus på långa/korta aktiepositioner i teknik- eller teknikpåverkade sektorer i Norden och Europa. Strategin förvaltas av Henrik Nyblom inom den nya strukturen för förvaltarmandat, vilken är exklusiv för andelsägare i BMS. Den initiala allokeringen var ca 5 procent.

Sedan den 1 juni investerar BMS även i den nya strategin Florin Court Capital Systematic Macro som fokuserar på relativvärdering baserad på signaler framtagna med hjälp av såväl teknisk som fundamental data i alternativa marknader. Den initiala allokeringen uppgick till ca 3 procent.

BMS kommer vidare att lösa in hela sitt innehav i den diskretonära globala makrohedgefonden Arete Macro Feeder fund som funnits i BMS:s portfölj sedan augusti 2016. Syftet med alla investeringsbeslut är att ytterligare förbättra BMS. Arete har bidragit positivt till BMS:s avkastning; beslutet att lösa in hela innehavet bygger på en samlad bedömning av Aretes förutsättningar att framgent generera god riskjusterad avkastning åt BMS, i jämförelse med övriga strategier i portföljen. BMS kommer att helt ha löst in sitt innehav i Arete per den 1 augusti 2022. Det inlösta kapitalet kommer att fördelas inom befintlig portfölj.

Under det fjärde kvartalet 2022 avser BMS att investera i en ny marknadsneutral strategi med fokus på långa/korta aktiepositioner inom hälsa och sjukvård primärt i Europa och USA. Strategin kommer att förvaltas av Hans Mähler inom den nya strukturen för förvaltarmandat, vilken är exklusiv för andelsägare i BMS.

Kontaktinformation

Investerarfrågor: +46 8 566 214 80 eller info@brummer.se

Pressfrågor: Johanna Hoffstedt +46 73 987 43 11 eller johanna.hoffstedt@brummer.se

Brummer & Partners är en ledande europeisk hedgefondförvaltare som samlar förvaltare med olika förvaltningsstrategier i en företagsgrupp. All förvaltning utgår från riskbedömning. Tillsammans förvaltar vi cirka 144 miljarder kronor på uppdrag av privatpersoner, företag och institutionella investerare. Brummer & Partners har kontor i sju länder och huvudkontor i Stockholm. Gruppen har cirka 300 anställda.

Brummer Multi-Strategy (BMS) investerar i olika singelstrategier inom Brummer & Partners-gruppen och har även exklusiva förvaltarmandat. Målet för BMS är att över tid leverera en konkurrenskraftig riskjusterad avkastning oavsett marknadsmiljö och därmed vara ett komplement i en portfölj bestående av mer riskfyllda tillgångar som aktier och räntor. BMS portfölj består av tusentals positioner som övervakas i realtid. Läs mer på [brummer.se](https://www.brummer.se)