



Stockholm, februari 2022

# Ny strategi i BMS

**Brummer Multi-Strategy-teamet diversifierar portföljen ytterligare genom att addera en ny strategi inriktad på systematisk makro.**

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

Kerim Celebi, portföljförvaltare i Brummer Multi-Strategy (BMS), nämnde i en videointervju nyligen att flera faktorer pekar mot högre volatilitet och en större spridning i avkastning både inom och mellan olika tillgångsslag och länder. Han förklarade också hur BMS:s portfölj har strukturerats för att vara robust i en makromiljö med högre grad av osäkerhet, samt kunna gynnas av ökade möjligheter att hitta vinnare och förlorare inom olika tillgångsslag och marknader.

Som ett led i detta arbete kommer BMS att investera i en ny strategi som lanseras av Florin Court Capital LPP (FCC), som sedan tidigare förvaltar FCC:s huvudsakligen trendföljande strategi inom tillväxt- och icke-traditionella marknader. Den nya strategin, **Florin Court Capital Systematic Macro Fund**, kommer att verka inom samma typer av marknader, men ha en helt annan inriktning och fokusera på relativvärdering. Både fundamentala och tekniska modeller används inom fyra olika tillgångsklasser i syfte att maximera avkastningen från systematiska samband mellan olika tillgångar. Modellerna har utvecklats av FCC:s förvaltare under lång tid och har handlats inom FCC:s befintliga förvaltning sedan några år tillbaka.

”Vi har starkt förtroende för FCC:s team och ser fram emot att investera en del av BMS i den systematiska makrostrategin. Vi har följt dessa modeller under några år och den riskjusterade avkastningen har, i linje med våra förväntningar, varit konkurrenskraftig med låg korrelation till våra existerande strategier och andra riskfaktorer. Det är en relativt unik och kompletterande form av förvaltning inom tillväxtmarknader. Vi bedömer att programmet har potential att generera konkurrenskraftig riskjusterad avkastning i olika marknadsscenarioer och strategin kommer att förstärka diversifieringen i BMS ytterligare”, kommenterar Kerim Celebi.

“Vår nya fond applicerar systematiska modeller på alternativa marknader, exempelvis räntor i tillväxtmarknader och diverse av råvaror. Det är ett unikt investeringsprogram med låg korrelation till i stort sett allt, inklusive trendföljande strategier” berättar Doug Greenig, CIO på FCC.

1 (2)



Lansering av Florin Court Capital Systematic Macro Fund beräknas ske i april 2022.

## Pressrelaterat bildmaterial

Pressrelaterat bildmaterial kan laddas ned [här](#).

## Kontaktinformation

Investerarfrågor: +46 8 566 214 80 eller [info@brummer.se](mailto:info@brummer.se)

Pressfrågor: Johanna Hoffstedt +46 73 987 43 11 eller [johanna.hoffstedt@brummer.se](mailto:johanna.hoffstedt@brummer.se)

-----

Brummer & Partners är en ledande europeisk hedgefondförvaltare som samlar förvaltare med olika förvaltningsstrategier i en företagsgrupp. Tillsammans förvaltar vi mer än 125 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 investerar i olika singelstrategier inom Brummer & Partners-gruppen. Dessa hedgefonder strävar alla efter att skapa avkastning oberoende av marknadsutvecklingen, men är helt olika i sina inriktningar och har låg inbördes korrelation. Målet för Brummer Multi-Strategy är att över tid leverera en konkurrenskraftig riskjusterad avkastning oavsett marknadsmiljö, med låg korrelation mot traditionella tillgångsslag som aktier och obligationer. Läs mer på [brummer.se](http://brummer.se).