

HAVSFRUN

INVESTMENT AB

Pressmeddelande 15 oktober 2021 för offentliggörande kl 15.00
Substansvärderapport per 30 september 2021

Substansvärdet per aktie minskade med 1,5 % under september

Beräknat substansvärde 30 september 2021 uppgick till 140,3 MKR (aug 2021: 142,4), motsvarande 11,59 kr per aktie (11,76)

Avkastning & riskmått: januari 1995 - september 2021

	Havsfruns substansvärde per aktie*	Havsfruns B-aktie	HFRI Fund of Fund Composite Index	MSCI AC World Index	Obligationsindex, Sverige	Penningmarknadsindex, Sverige	Blandportfölj (MSCI World/Obl.index)
Avkastning september	-1,5%	-4,6%	0,8%	-4,1%	-1,4%	0,0%	-2,8%
Avkastning 6 månader	-1,3%	-8,4%	4,2%	6,2%	0,0%	-0,1%	3,1%
Avkastning 2021	1,4%	22,9%	6,2%	11,0%	-1,9%	-0,1%	4,4%
Avkastning 12 månader	4,0%	28,2%	14,8%	27,2%	-2,2%	-0,2%	11,9%
Effektiv årsavkastning 3 år	-3,6%	17,3%	5,4%	11,2%	0,8%	-0,4%	6,3%
Effektiv årsavkastning 5 år	-2,6%	11,5%	4,3%	11,5%	0,2%	-0,5%	6,0%
Effektiv årsavkastning 1995	5,9%	11,9%	5,2%	7,6%	5,4%	2,2%	6,9%
Standardavvikelse, %	19,5%	22,8%	5,7%	15,3%	4,1%	0,7%	7,5%
Sharpe kvot	0,2	0,4	0,5	0,4	0,8	0,0	0,6
Antal positiva månader, %	52%	52%	67%	64%	64%	75%	68%
Bästa månad	91,2%	53,4%	6,7%	12,3%	3,9%	0,7%	6,0%
Sämsta månad	-12,3%	-23,6%	-7,7%	-19,6%	-2,9%	-0,1%	-8,4%

Avkastning: januari 1995 - september 2021

År	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	Havsfruns substansvärde per aktie*	Havsfruns B-aktie	HFRI Fund of Fund Composite Index	MSCI AC World Index	Obligationsindex, Sverige	Penningmarknadsindex, Sverige	Blandportfölj (MSCI World/Obl.index)
2021	0,6%	1,0%	1,1%	0,4%	1,0%	-1,1%	0,8%	-0,9%	-1,5%				1,4%	22,9%	6,2%	11,0%	-1,9%	-0,1%	4,4%
2020	-0,7%	-4,4%	-9,9%	0,8%	1,2%	0,4%	1,4%	1,0%	-0,6%	-1,5%	2,2%	2,0%	-8,6%	26,4%	10,3%	15,7%	1,0%	-0,2%	9,0%
2019	0,0%	0,2%	0,3%	1,1%	-1,3%	0,9%	0,2%	1,4%	-1,7%	-0,5%	0,0%	1,4%	2,0%	13,5%	5,8%	23,7%	2,4%	-0,5%	12,8%
2018	1,5%	-2,5%	-0,4%	0,0%	0,1%	-0,4%	-1,1%	0,7%	0,0%	-2,3%	-2,3%	-0,7%	-7,4%	-4,4%	-6,5%	-11,7%	1,7%	-0,8%	-5,0%
2017	-0,6%	0,6%	-0,3%	-0,4%	0,7%	-1,5%	0,7%	0,6%	-0,6%	1,2%	-1,0%	0,1%	-0,5%	4,4%	6,0%	21,9%	0,1%	-0,8%	10,5%
2016	-3,4%	-2,0%	0,3%	0,0%	0,6%	0,7%	1,9%	-0,4%	-0,4%	0,4%	-0,4%	0,6%	-2,1%	-6,7%	-0,6%	6,7%	4,1%	-0,7%	5,6%
2015	3,8%	2,6%	0,7%	-1,1%	1,4%	-2,4%	0,9%	-2,5%	-2,5%	-0,2%	1,2%	-1,0%	0,6%	16,2%	-0,7%	-2,8%	-0,2%	-0,3%	-1,3%
2014	-0,4%	1,4%	-1,6%	-1,0%	0,9%	0,7%	-0,6%	0,7%	1,8%	-1,2%	2,4%	1,9%	5,1%	26,9%	3,8%	4,6%	12,1%	0,5%	8,4%
2013	1,5%	0,7%	0,9%	0,8%	0,3%	-1,7%	1,0%	-0,5%	1,4%	1,1%	1,4%	1,5%	9,0%	28,9%	9,9%	23,9%	-3,3%	0,9%	9,6%
2012	1,6%	1,3%	-0,3%	0,1%	-1,2%	-1,5%	1,8%	0,7%	0,2%	-0,4%	0,5%	-0,2%	2,7%	14,5%	6,4%	17,9%	1,6%	1,2%	9,9%
2011	0,8%	0,0%	-0,2%	0,3%	-0,7%	-1,5%	-0,3%	-3,0%	-2,1%	0,0%	-1,8%	-2,2%	-10,3%	-8,7%	-3,9%	-5,5%	13,3%	1,6%	4,0%
2010	-0,3%	-0,3%	1,5%	0,5%	-2,3%	-0,3%	0,8%	-0,5%	2,2%	0,3%	-0,6%	2,1%	3,0%	-1,8%	6,2%	13,2%	2,9%	0,3%	8,7%
2009	0,1%	1,2%	-1,3%	-1,1%	0,8%	1,5%	1,2%	-0,2%	1,1%	0,5%	0,0%	0,2%	4,1%	24,4%	11,9%	35,2%	-0,9%	0,4%	16,7%
2008	-5,2%	1,9%	-2,2%	2,0%	3,6%	-2,0%	-3,3%	-1,1%	-11,3%	-12,3%	-3,9%	-7,1%	-35,0%	-41,1%	-19,8%	-41,0%	15,7%	4,3%	-16,2%
2007	1,3%	-0,5%	2,4%	2,0%	3,1%	0,7%	-2,0%	-2,1%	1,8%	2,6%	-3,0%	0,7%	6,9%	-13,3%	8,7%	10,1%	1,6%	3,4%	5,9%
2006	4,1%	0,9%	1,5%	1,7%	-4,1%	-1,7%	-1,0%	0,9%	0,7%	2,5%	2,2%	3,0%	11,0%	13,5%	7,5%	17,8%	0,9%	2,2%	9,1%
2005	-0,3%	1,1%	-0,4%	-0,7%	2,1%	2,0%	2,1%	0,5%	3,3%	-3,0%	3,3%	2,6%	13,2%	14,8%	5,8%	9,1%	5,4%	1,9%	7,4%
2004	0,5%	0,0%	0,2%	-1,7%	-1,5%	0,5%	0,0%	-0,5%	-1,3%	0,3%	1,5%	1,1%	-0,9%	4,8%	7,6%	16,1%	8,3%	2,6%	12,2%
2003	-0,9%	-1,8%	0,9%	0,2%	0,0%	-0,5%	1,4%	1,4%	91,2%	1,4%	-0,5%	0,7%	95,9%	154,1%	13,9%	36,7%	4,9%	3,5%	20,1%
2002	-2,1%	0,9%	0,4%	1,5%	-1,3%	-2,2%	0,9%	-0,9%	-1,4%	1,4%	1,4%	0,0%	-1,6%	6,2%	3,5%	-17,3%	9,0%	4,6%	-4,5%
2001	0,0%	3,2%	0,0%	2,2%	0,9%	-1,8%	0,5%	2,3%	1,3%	0,0%	0,0%	2,6%	11,7%	29,1%	3,2%	-15,9%	2,8%	4,3%	-6,5%
2000	1,9%	0,5%	0,5%	-2,4%	2,4%	0,9%	0,5%	0,9%	-0,9%	0,0%	0,9%	1,4%	6,7%	8,3%	1,5%	-16,4%	9,7%	4,3%	-4,0%
1999	-2,2%	-1,7%	4,0%	4,8%	2,1%	-0,5%	0,0%	-1,1%	-2,1%	1,1%	6,5%	6,6%	18,2%	27,5%	23,9%	23,9%	-2,4%	3,3%	10,2%
1998	0,0%	0,0%	0,0%	13,5%	0,0%	0,0%	0,0%	10,8%	0,0%	0,0%	0,0%	5,1%	32,1%	14,4%	-6,3%	20,4%	13,9%	4,9%	17,7%
1997	0,0%	0,0%	0,0%	4,1%	0,0%	0,0%	0,0%	2,4%	0,0%	0,0%	0,0%	11,0%	18,4%	11,5%	14,7%	13,5%	7,9%	4,1%	10,8%
1996	0,0%	0,0%	0,0%	1,4%	0,0%	0,0%	0,0%	1,4%	0,0%	0,0%	0,0%	9,0%	12,0%	8,0%	15,0%	13,8%	18,6%	6,7%	16,2%
1995	0,0%	0,0%	0,0%	0,5%	0,0%	0,0%	0,0%	0,5%	0,0%	0,0%	0,0%	13,7%	14,9%	10,8%	14,1%	22,6%	20,0%	8,6%	21,4%

Substansvärde och B-aktie

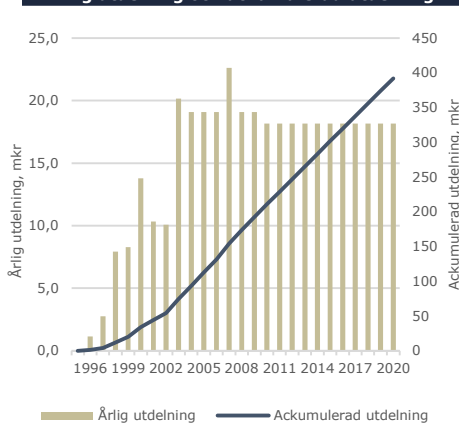
	sep-21	aug-21	dec-20
Totalt substansvärde, mkr	140,3	142,4	156,0
Substansvärde per aktie, kr	11,59	11,76	12,89
Börsvärde, mkr	288,7	302,6	248,2
B-aktiens kurs, kr	23,85	25,00	20,50
Substansrabatt per aktie, kr*	-12,26	-13,24	-7,61
Substansrabatt per aktie, %*	-105,8%	-112,6%	-59,1%

*Rabatt (+), premie (-)

Investeringsportföljen

	sep-21	aug-21	dec-20
Aktiv fondportfölj, mkr	46,7	48,4	42,3
Avvecklingsportfölj, mkr	5,4	5,2	5,5
Övriga placeringar, mkr	0,0	0,0	0,0
Investeringsportfölj, mkr	52,1	53,6	47,9
Investeringsgrad, %	37,1%	37,6%	30,7%

Årlig utdelning och ackumulerad utdelning



Utdelning per aktie och direktavkastning



Av investeringsportföljen är 31,0 mkr bekräftade värden, 15,6 mkr är beräknade värden och 5,5 mkr är av bolaget uppskattade värden.

För definitioner se www.havsfrun.se. Index redovisas av jämförelseskäl omräknat till SEK. För ytterligare information: Jonas Israelsson, VD, 08-50677700. Pressmeddelanden finns att hämta på www.havsfrun.se