

HAVSFRUN

INVESTMENT AB

Pressmeddelande 14 september 2020 för offentliggörande kl 15.30

Substansvärderapport per 31 augusti 2020

Substansvärdet per aktie ökade med 1 % under augusti

Beräknat substansvärde 31 augusti 2020 uppgick till 152,9 MKR (jul 2020: 151,4), motsvarande 12,63 kr per aktie (12,51)

Avkastning & riskmått: januari 1995 - augusti 2020

	Havsfruns substansvärde per aktie	Havsfruns B-aktie	HFRI Fund of Fund Composite Index	MSCI AC World Index	Obligationsindex, Sverige	Penningsmarknadsindex, Sverige	Blandportfölj (MSCI World / Obl.index)
Avkastning augusti	1,0%	5,7%	2,0%	6,1%	-0,5%	0,0%	2,8%
Avkastning 6 månader	-5,6%	4,7%	3,9%	15,0%	-2,1%	-0,1%	6,6%
Avkastning 2020	-10,5%	8,9%	2,4%	4,3%	0,5%	-0,2%	3,0%
Avkastning 12 månader	-11,3%	16,4%	4,3%	15,5%	-2,6%	-0,4%	6,8%
Effektiv årsavkastning 3 år	-5,6%	6,3%	1,1%	7,3%	1,6%	-0,6%	4,8%
Effektiv årsavkastning 5 år	-4,3%	4,2%	1,0%	8,9%	1,4%	-0,6%	5,4%
Effektiv årsavkastning 1995	6,0%	10,9%	4,9%	7,5%	5,7%	2,3%	7,0%
Standardavvikelse, %	19,9%	22,7%	5,7%	15,3%	4,1%	0,7%	7,5%
Sharpe kvot	0,2	0,4	0,4	0,3	0,8	0,0	0,6
Antal positiva månader, %	51%	53%	67%	63%	65%	78%	67%
Bästa månad	91,2%	53,4%	6,7%	11,9%	3,9%	0,7%	5,4%
Sämsta månad	-12,3%	-23,6%	-7,7%	-19,6%	-2,9%	-0,1%	-8,4%

Avkastning: januari 1995 - augusti 2020

År	Avkastning per månad												Havsfruns substansvärde per aktie	Havsfruns B-aktie	HFRI Fund of Fund Composite Index	MSCI AC World Index	Obligationsindex, Sverige	Pennyindex, Sverige	tföj (MSCI World / Obl.index)
	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec							
2020	-0,7%	-4,4%	-9,9%	0,8%	1,2%	0,4%	1,4%	1,0%	-1,7%	-0,5%	0,0%	1,4%	-10,5%	8,9%	2,4%	4,3%	0,5%	-0,2%	3,0%
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%	24,4%	2,4%	-0,5%	13,1%
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%	-11,3%	1,7%	-0,8%	-4,7%
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%	22,6%	0,1%	-0,8%	10,8%
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%	7,3%	4,1%	-0,7%	5,9%
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%	-2,3%	-0,2%	-0,3%	-1,0%
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%	5,1%	12,1%	0,5%	8,7%
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%	24,6%	-3,3%	0,9%	9,9%
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%	18,6%	1,6%	1,2%	10,2%
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%	-5,0%	13,3%	1,6%	4,3%
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%	13,8%	2,9%	0,3%	9,0%
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%	35,9%	-0,9%	0,4%	17,0%
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%	-40,7%	15,7%	4,3%	-15,9%
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%	10,6%	1,6%	3,4%	6,2%
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%	18,4%	0,9%	2,2%	9,4%
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%	9,6%	5,4%	1,9%	7,6%
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%	16,6%	8,3%	2,6%	12,5%
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%	37,3%	4,9%	3,5%	20,3%
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%	-16,9%	9,0%	4,6%	-4,3%
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%	-15,6%	2,8%	4,3%	-6,4%
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%	-16,1%	9,7%	4,3%	-3,8%
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%	24,2%	-2,4%	3,3%	10,3%
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

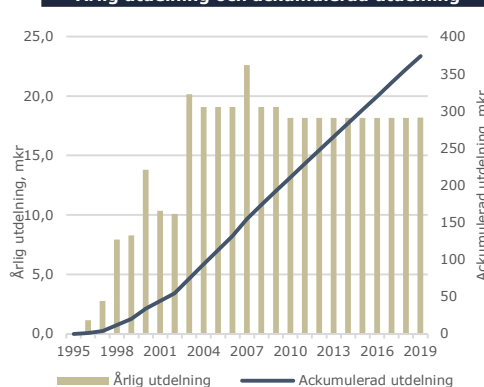
	aug-20	jul-20	dec-19
Totalt substansvärde, mkr	152,9	151,4	191,5
Substansvärde per aktie, kr	12,63	12,51	15,82
Börsvärde, mkr	213,7	202,2	214,3
B-aktiens kurs, kr	17,65	16,70	17,70
Substansrabatt per aktie, kr*	-5,02	-4,19	-1,88
Substansrabatt per aktie, %*	-39,8%	-33,5%	-11,9%

*Rabatt (+), premie (-)

Investeringsportföljen

	aug-20	jul-20	dec-19
Aktiv fondportfölj, mkr	44,1	42,3	143,5
Avvecklingsportfölj, mkr	5,8	5,8	6,2
Övriga placeringar, mkr	0,0	0,0	0,0
Investeringsportfölj, mkr	49,9	48,1	149,7
Investeringsgrad, %	32,7%	31,7%	78,2%

Årlig utdelning och ackumulerad utdelning



Utdelning per aktie och direktavkastning



Av investeringsportföljen är 36,7 mkr bekräftade värden, 7,3 mkr är beräknade värden och 5,9 mkr är av bolaget uppskattade värden.

Placeringar i utländsk valuta neutraliseras i normalfallet genom valutaterminer, vilket medför att substansutvecklingen inte påverkas i någon väsentlig omfattning av valutakursförändringar. För definitioner se www.havsfrun.se. Index redovisas av jämförelseskal omräknat till SEK. För ytterligare information: Jonas Israelsson, VD, 08-50677700. Våra pressmeddelanden finns att hämta på www.havsfrun.se