

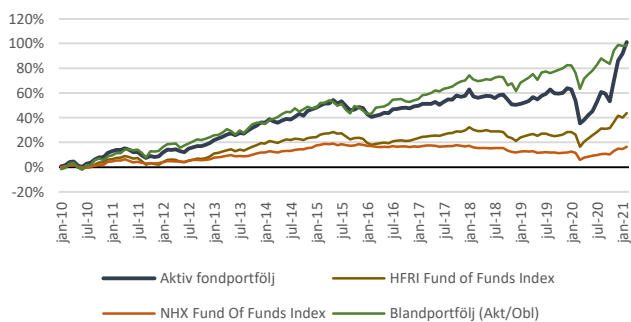
AVKASTNING OCH RISKMÅTT FR.OM. JANUARI 2010

*	Aktiv fondportfölj	HFRI Fund of Funds Index	NHX Fund Of Funds Index	MSCI AC World Index	Blandportfölj (Akt/Obl)	OMRX Treasury Bond Index	OMRX Treasury Bill Index
Avkastning februari	4,9%	2,6%	1,6%	2,3%	0,3%	-1,8%	0,0%
Avkastning 2021	8,1%	1,6%	1,5%	1,8%	-0,1%	-2,1%	0,0%
Avkastning 6 månader	25,1%	9,5%	5,5%	12,9%	5,7%	-1,6%	-0,1%
Avkastning 12 månader	30,8%	13,8%	4,5%	29,9%	12,7%	-3,6%	-0,2%
Effektiv årsavkastning 2 år	14,9%	7,2%	1,6%	14,9%	8,0%	0,4%	-0,3%
Effektiv årsavkastning 3 år	8,6%	3,4%	0,1%	8,4%	5,1%	1,0%	-0,5%
Effektiv årsavkastning sedan januari 2010	6,5%	3,3%	1,4%	9,1%	6,3%	2,9%	0,1%
Standardavvikelse, %	8,1%	5,0%	2,9%	14,6%	6,8%	3,9%	0,2%
Sharpe kvot	0,8	0,6	0,4	0,6	0,9	0,7	0,0
Antal positiva månader, %	64,9%	64,9%	61,2%	64,2%	68,7%	56,0%	44,8%
Bästa månad	10,9%	3,9%	2,6%	12,3%	6,0%	3,3%	0,2%
Sämsta månad	-12,0%	-7,7%	-5,1%	-13,6%	-7,3%	-2,3%	-0,1%
Största värdefall	-17,4%	-11,9%	-11,1%	-21,6%	-10,5%	-5,4%	-3,3%
Korrelation mot MSCI AC World	0,70	0,86	0,64	1,00	0,96	-0,38	-0,02
Beta mot MSCI AC World	0,39	0,29	0,13	1,00	0,45	-0,10	0,00

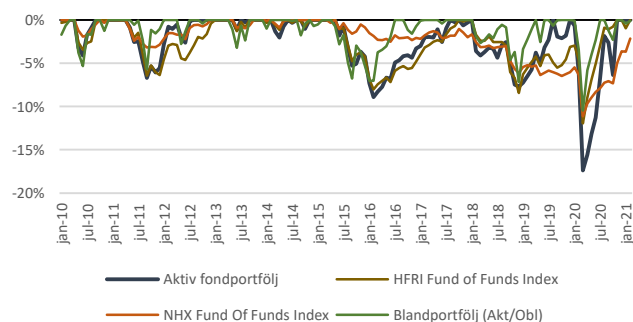
MÅNADSAVKASTNING AKTIV FONDPORTFÖLJ

År	Jan	Feb	Mar	Apr	Maj	Jun	Jul	Aug	Sep	Okt	Nov	Dec	År
2021	3,1%	4,9%											8,1%
2020	-0,7%	-5,5%	-12,0%	2,1%	2,8%	2,2%	5,2%	5,2%	-0,8%	-3,9%	10,9%	9,5%	13,6%
2019	0,5%	0,8%	0,8%	2,1%	-1,3%	1,9%	0,9%	2,3%	-1,9%	-0,2%	0,3%	2,4%	9,0%
2018	3,4%	-3,6%	-0,6%	0,4%	0,6%	-0,2%	-1,0%	1,5%	0,4%	-2,6%	-2,5%	-0,3%	-4,6%
2017	0,3%	1,0%	0,0%	-0,1%	1,0%	-1,5%	1,6%	1,4%	-0,3%	2,3%	-0,6%	0,4%	5,6%
2016	-3,2%	-1,7%	0,7%	0,6%	1,2%	-0,2%	2,0%	0,3%	0,5%	0,1%	-0,3%	1,1%	1,0%
2015	1,0%	1,1%	1,0%	0,1%	1,9%	-1,8%	1,1%	-2,5%	-2,1%	0,3%	1,5%	-0,6%	0,7%
2014	-0,2%	2,0%	-1,3%	-0,7%	1,3%	1,0%	-0,4%	1,4%	1,7%	-1,1%	2,8%	0,8%	7,6%
2013	2,1%	0,9%	1,2%	1,4%	0,7%	-1,2%	1,4%	-0,3%	2,0%	1,6%	1,3%	2,0%	14,0%
2012	2,9%	2,1%	-0,2%	0,5%	-1,4%	-0,7%	2,6%	0,8%	1,0%	-0,1%	0,9%	1,3%	9,9%
2011	1,3%	0,8%	0,0%	1,1%	-0,9%	-1,7%	0,1%	-2,4%	-2,0%	1,4%	-0,7%	0,5%	-2,5%
2010	0,6%	1,0%	2,5%	0,4%	-3,2%	-0,9%	2,5%	0,8%	2,7%	1,6%	0,0%	3,2%	11,5%

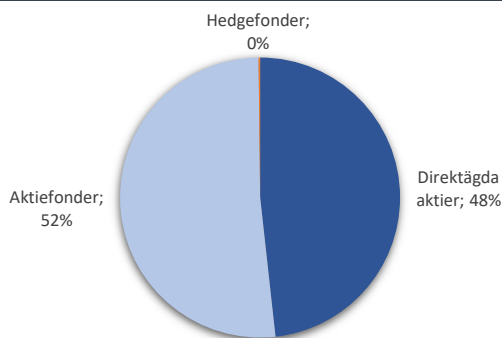
ACKUMULERAD AVKASTNING



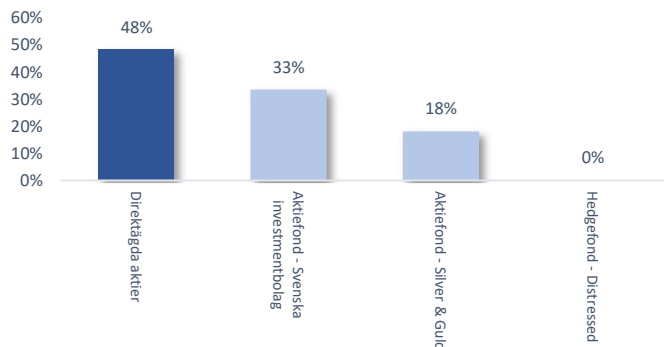
HISTORISKA VÄRDEFALL



STRATEGIFÖRDELNING AKTIV FONDPORTFÖLJ



INNEHAVENS PLACERINGSINRIKTNING OCH ANDEL AV AKTIV FONDPORTFÖLJ



\*Aktiv fondportfölj avkastning i SEK på bolagets placeringar, före bolagets omkostnader, exklusive kassa. För definitioner och begrepp, se Havsfruns hemsida, [www.havsfrun.se](http://www.havsfrun.se), eller i Havsfruns årsredovisning. HFRI Fund of Funds Index är ett globalt fond-av-hedgefondindex, NHX Fund Of Funds Index är ett nordiskt fond-av-hedgefondindex, MSCI AC World Index är ett globalt aktieindex, Blandportfölj (Akt/Obl) är ett likaviktat index med MSCI AC World Index och OMRX Treasury Bond Index, OMRX Treasury Bill Index är ett index för svenska statskuldväxlar och OMRX Treasury Bond Index är ett index för svenska statsobligationer. Samtliga index redovisas av jämförelseskal omräknat till SEK.