HAVSFRUN
INVESTMENT AB

Pressmeddelande 18 augusti 2020 för offentliggörande kl 15.30

Substansvärderapport per 31 juli 2020

Substansvärdet per aktie ökade med 1,4 % under juli

Beräknat substansvärde 31 juli 2020 uppgick till 151,4 MKR (jun 2020: 149,3), motsvarande 12,51 kr per aktie (12,33)

Avkastning & riskmått: januari 1995 - juli 2020

	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 juli	**1,4%**	2,1%	2,8%	5,3%	0,0%	0,0%	2,6%
Avkastning 6 månader	**-10,7%**	-5,5%	0,7%	-0,5%	0,0%	-0,1%	0,3%
Avkastning 2020	**-11,3%**	3,0%	0,8%	-1,7%	1,0%	-0,1%	0,2%
Avkastning 12 månader	**-10,8%**	9,5%	1,7%	6,1%	-0,9%	-0,4%	3,2%
Effektiv årsavkastning 3 år	**-5,7%**	4,3%	0,8%	5,3%	2,1%	-0,6%	4,0%
Effektiv årsavkastning 5 år	**-5,0%**	3,6%	0,3%	6,1%	1,6%	-0,6%	4,1%
Effektiv årsavkastning 1995	**6,0%**	10,7%	4,8%	7,3%	5,7%	2,3%	6,9%
Standardavvikelse, %	**19,9%**	22,8%	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%	64%	65%	78%	68%
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%

** återinvesterad utdelning*

Avkastning: januari 1995 - juli 2020

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	tfölj (MSCI World / Obl.index)
2020	-0,7%	-4,4%	-9,9%	0,8%	1,2%	0,4%	1,4%						**-11,3%**	3,0%	0,8%	-1,7%	1,0%	-0,1%	0,2%
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

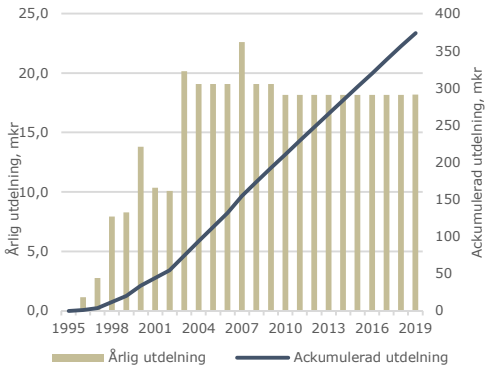
	jul-20	jun-20	dec-19
Totalt substansvärde, mkr	151,4	149,3	191,5
Substansvärde per aktie, kr	12,51	12,33	15,82
Börsvärde, mkr	202,2	197,9	214,3
B-aktiens kurs, kr	16,70	16,35	17,70
Substansrabatt per aktie, kr*	-4,19	-4,02	-1,88
Substansrabatt per aktie, %*	-33,5%	-32,6%	-11,9%

**Rabatt (+), premie (-)*

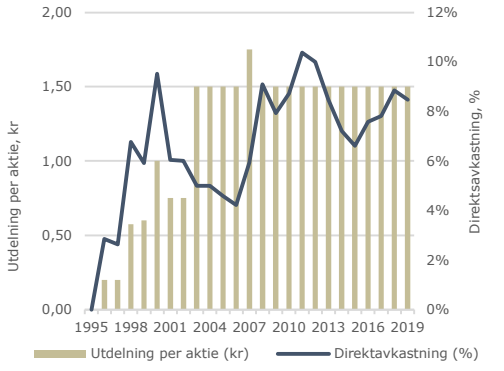
Investeringsportföljen

	jul-20	jun-20	dec-19
Aktiv fondportfölj, mkr	42,3	53,1	143,5
Avvecklingsportfölj, mkr	6,0	6,5	6,2
Övriga placeringar, mkr	0,0	0,0	0,0
Investeringsportfölj, mkr	**48,3**	**59,6**	**149,7**
Investeringsgrad, %	31,9%	39,9%	78,2%

Årlig utdelning och ackumulerad utdelning



Utdelning per aktie och direktavkastning



Av investeringsportföljen är 27,2 mkr bekräftade värden, 15,0 mkr är beräknade värden och 6,1 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 jämförelseskäl omräknat till SEK. För ytterligare information: Jonas Israelsson, VD, 08-50677700. Våra pressmeddelanden finns att hämta på www.havsfrun.se

Havsfrun Investment AB (publ) | Strandvägen 1 | SE-114 51 Stockholm | Org.nr 556311-5939 | Styrelsens säte Stockholm | Tel +46 8 506 777 00 | www.havsfrun.se