

Fokus detta aktiekafé:

- Avkastning, se sammanfattning sida 3

Uppföljning screeningstrategierna

Utveckling 2024-11-28

Johan Törnström
Aktiespararna Haninge

Innehåll

- Sammanställning
 - Avkastning i olika tidsperspektiv, tabell
- Magic Formula
 - Magic Formula, Greenblatt, årsvis och rullande per kvartal
 - Magic Formula + Momentum, årligt byte
- F-Score
 - F-Score, årligt byte
 - F-Score + Momentum, byte varje kvartal
- Stabil tillväxt
 - Stabil tillväxt, årligt byte
 - Stabil tillväxt + Momentum, årligt byte
 - Stabil tillväxt + Momentum, byte varje kvartal
 - Stabil tillväxt + F-Score, årligt byte
- 10 aktier som gett bäst avkastat i portföljerna senaste 3 mån
 - Tio-i-topp, byte varje kvartal

Screeningportföljers avkastning

Portfölj För detaljerad beskrivning se: Screeningstrategier - Regelverk	Antal mån	Avkastning , Sedan start	Årsavkastn. sedan start CAGR	Avk. 2023	Avk. 2024	Avk. 1 år	Avk. 3 mån	Avk. 1 mån
1. Greenblatt, Magic formula, byte ¼ /kv	57	+65%	11,1 %/år	-4%	+17%	+24%	0%	0%
2. Magic formula + Mom, byte år	57	+59%	10,3 %/år	+8%	+1%	+8%	-10%	-6%
3. F-Score, byte år	57	+55%	9,7 %/år	-2%	-2%	+6%	-1%	-3%
4. F-Score + Mom, byte kv	57	+135%	19,7 %/år	-8%	+21%	+20%	-7%	-6%
5. Stabil tillväxt, byte år	57	+80%	13,2 %/år	+16%	-21%	-12%	-5%	+1%
6. Stabil tillväxt + Momentum, byte år	9	-7%	-9,2 %/år	-	-	-	-5%	-2%
7. Stabil tillväxt + Mom, byte kv	57	+18%	3,5 %/år	-4%	+2%	+16%	+6%	-3%
8. Stabil tillväxt + F-Score, byte år	6	+3%	6,1 %/år	-	-	-	+4%	+2%
9. Tio-i-topp	36	-4%	-1,4 %/år	+2%	+7%	+20%	+2%	-3%
Index OMXSGI från 2020-02-28	57	+71%	12,0 %/år					
Index OMXSGI från 2021-11-30	36	+6%	2,0 %/år					
Index OMXSGI från 2024-02-28	9	+7%	9,4 %/år					
Index OMXSGI från 2024-05-17	6	-3%	-5,9 %/år					
Index OMXSGI				+19%	+13%	+20%	-3%	-4%

CAGR står för Compound Annual Growth Rate
Genomsnittlig årlig avkastningen i procent



Bättre än eller
lika med index

1. Magic Formula, Greenblatt, årligt byte rullande per kvartal



	Utv 4 år 9 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Greenblatt	+65%	+24%	0%	0%
OMXSGI	+71%	+20%	-3%	-4%

Observation, se pilar i diagrammet

- Från start till 2022-01-04, all time high, har portföljen gått 31% bättre än index, 102% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 17% sämre än index, portfölj -41% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-11-28 har portföljen gått 4% bättre än index, portfölj +36% och index +32%

1. Magic Formula, Greenblatt, årligt byte rullande per kvartal

Innehav, 2024-11-28									
Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt värde	+/-	% ▼	
[-] SVENSKA AKTIER									
📈 Verve Group	647	17,1%	19,20	41,00	12 422	26 527	+14 105	+113,5%	
📈 Hexatronic Group	178	4,3%	20,74	37,48	3 692	6 671	+2 980	+80,7%	
📈 Intellego Technologies	278	6,8%	24,40	37,75	6 783	10 495	+3 711	+54,7%	
📈 Betsson B	66	6,1%	102,40	144,38	6 758	9 529	+2 771	+41,0%	
📈 Doro	285	6,0%	24,10	32,80	6 869	9 348	+2 480	+36,1%	
📈 Softronic B	294	4,6%	23,10	24,30	6 791	7 144	+353	+5,2%	
📉 Veteranpoolen B	186	4,3%	36,80	36,00	6 845	6 696	-149	-2,2%	
📉 Novotek B	180	7,8%	68,80	67,00	12 384	12 060	-324	-2,6%	
📉 Volvo B	23	4,0%	285,10	272,40	6 557	6 265	-292	-4,5%	
📉 Combinedx	106	2,2%	34,70	32,40	3 678	3 434	-244	-6,6%	
📉 Fractal Gaming Group	100	2,0%	37,00	31,60	3 700	3 160	-540	-14,6%	
📉 Nordrest	53	3,6%	128,40	106,80	6 805	5 660	-1 145	-16,8%	
📉 Berner Industrier B	327	6,5%	38,00	31,00	12 426	10 137	-2 289	-18,4%	
📉 ProfilGruppen B	99	6,5%	125,00	102,00	12 375	10 098	-2 277	-18,4%	
📉 Gentoo Media	399	6,4%	31,15	24,75	12 429	9 875	-2 554	-20,5%	
📉 Volvo Car B	229	3,5%	29,92	23,64	6 852	5 412	-1 439	-21,0%	
📉 Eolus Vind B	109	3,2%	62,80	45,50	6 845	4 960	-1 886	-27,5%	
📉 G5 Entertainment	24	1,6%	151,20	101,00	3 629	2 424	-1 205	-33,2%	
📉 SSAB B	83	2,7%	81,08	50,00	6 730	4 150	-2 580	-38,3%	
📉 Starbreeze B	6 860	0,9%	0,54	0,20	3 704	1 359	-2 345	-63,3%	
SUMMA		100,0%			148 275	155 405	+7 131	+4,8%	

2. Magic Formula + Momentum, årligt byte



	Utv 4 år 9 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
MF+Mom, år	+59%	+6%	-1%	-3%
OMXSGI	+71%	+20%	-3%	-4%

Observation, se pilar i diagrammet

- Från start till 2022-01-04, all time high, har portföljen gått 22% bättre än index, 93% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 4% sämre än index, portfölj -28% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-11-28 har portföljen gått 17% sämre än index, portfölj +15% och index +32%

2. Magic Formula + Momentum, årligt byte

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
📈 Verve Group	421	9,8%	19,20	41,00	8 083	17 261	+9 178	+113,5%
📈 Intellego Technolog	748	16,0%	24,40	37,75	18 251	28 237	+9 986	+54,7%
📈 Arla Plast	457	12,2%	39,90	47,20	18 234	21 570	+3 336	+18,3%
📈 Zinzino B	227	11,0%	80,40	85,30	18 251	19 363	+1 112	+6,1%
📈 VBG Group B	65	10,5%	277,50	284,50	18 038	18 493	+455	+2,5%
📉 Volvo B	64	9,9%	285,10	272,40	18 246	17 434	-813	-4,5%
📉 Berner Industrier B	556	9,8%	32,80	31,00	18 237	17 236	-1 001	-5,5%
📉 Envirologic B	945	8,0%	19,30	14,85	18 239	14 033	-4 205	-23,1%
📉 Combinedx	396	7,3%	46,00	32,40	18 216	12 830	-5 386	-29,6%
📉 Guideline Geo	1 233	5,5%	14,80	7,88	18 248	9 716	-8 532	-46,8%
SUMMA		100,0%			172 043	176 173	+4 130	+2,4%

3. F-Score, årligt byte



	Utv 4 år 9 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
F-Score, år	+55%	+10%	-3%	-1%
OMXSGI	+71%	+20%	-3%	-4%

Observation, se pilar i diagrammet

- Från start till 2022-01-04, all time high, har portföljen gått 13% bättre än index, 84% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 1% sämre än index, portfölj -25% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-11-28 har portföljen gått 18% sämre än index, portfölj +14% och index +32%

3. F-Score, årligt byte

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKA AKTIER								
↑ Lundin Gold	130	20,1%	118,60	255,00	15 418	33 150	+17 732	+115,0%
↑ RaySearch Labora	155	19,5%	99,30	207,00	15 392	32 085	+16 694	+108,5%
↑ Cloetta	863	13,6%	17,88	26,00	15 430	22 438	+7 008	+45,4%
↑ VBG Group B	55	9,5%	277,50	284,50	15 263	15 648	+385	+2,5%
↓ Fractal Gaming Gr	466	8,9%	33,10	31,60	15 425	14 726	-699	-4,5%
↓ Formpipe Software	532	8,0%	29,00	24,90	15 428	13 247	-2 181	-14,1%
↓ Combinedx	335	6,6%	46,00	32,40	15 410	10 854	-4 556	-29,6%
↓ Drillcon	2 360	6,5%	6,54	4,55	15 434	10 738	-4 696	-30,4%
↓ QleanAir	496	5,1%	31,10	16,95	15 426	8 407	-7 018	-45,5%
↓ AQ Group	27	2,2%	556,00	132,24	15 012	3 570	-11 442	-76,2%
SUMMA		100,0%			153 637	164 863	+11 226	+7,3%

4. F-Score + Momentum, byte varje kvartal



	Utv 4 år 9 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
F-Score + Mom, kv	+135%	+20%	-7%	-6%
OMXS GI	+71%	+20%	-3%	-4%

Observation, se pilar i diagrammet

- Från start till 2022-01-04, börsens all time high, har portföljen gått 51% bättre än index, 122% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 4% bättre än index, portfölj -20% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-11-28 har portföljen gått 2% sämre än index, portfölj +30% och index +32%

4. F-Score + Momentum, byte varje kvartal

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ RaySearch Labora	189	14,3%	157,00	207,00	29 673	39 123	+9 450	+31,8%
↑ Millicom Internation	111	11,4%	266,80	281,00	29 615	31 191	+1 576	+5,3%
↑ Sleep Cycle	730	11,1%	40,70	41,60	29 711	30 368	+657	+2,2%
↑ Essity B	98	10,9%	300,80	304,00	29 478	29 792	+314	+1,1%
↓ Bredband2	14 255	10,2%	2,09	1,96	29 722	27 968	-1 753	-5,9%
↓ Bokusgruppen	601	9,7%	49,40	44,30	29 689	26 624	-3 065	-10,3%
↓ CellaVision	112	9,2%	265,00	224,00	29 680	25 088	-4 592	-15,5%
↓ Careium	842	8,8%	35,30	28,80	29 723	24 250	-5 473	-18,4%
↓ Embellence Group	796	8,7%	37,30	29,80	29 691	23 721	-5 970	-20,1%
↓ Envirologic B	1 076	5,8%	27,60	14,85	29 698	15 979	-13 719	-46,2%
SUMMA		100,0%			296 679	274 104	-22 576	-7,6%

5. Stabil tillväxt, årligt byte



	Utv 4 år 9 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt, år	+80%	-12%	-5%	+1%
OMXSGI	+71%	+20%	-3%	-4%

Observation, se pilar i diagrammet

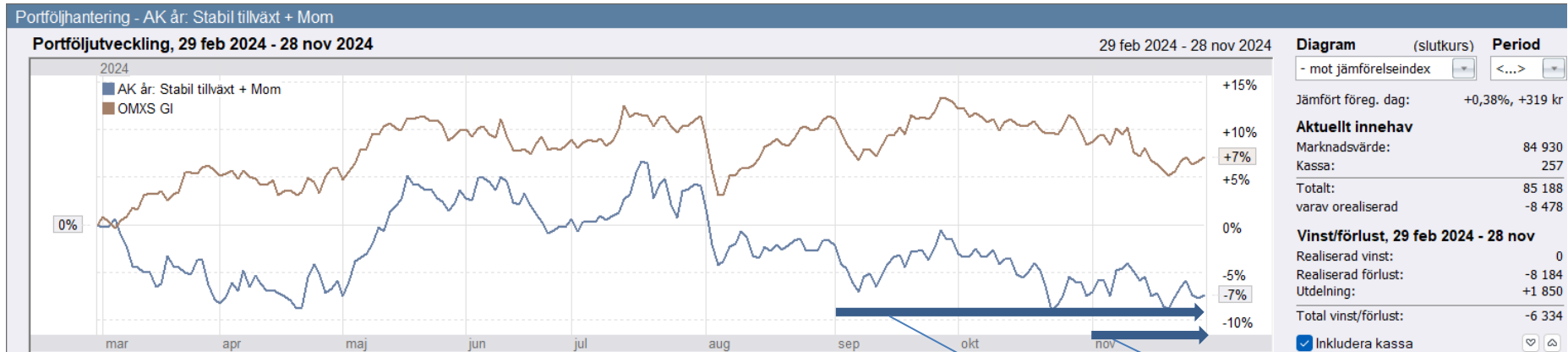
- Från start till 2022-01-04, all time high, har portföljen gått 85 bättre än index, 156% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 4% sämre än index, portfölj -28% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-11-28 har portföljen gått 34% sämre än index, portfölj -2% och index +32%

5. Stabil tillväxt, årligt byte

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Intellego Technolog	270	6,2%	29,00	37,75	7 830	10 193	+2 363	+30,2%
↑ Hexatronic Group	637	14,5%	31,62	37,48	20 142	23 875	+3 733	+18,5%
↑ Zinzino B	250	12,9%	80,40	85,30	20 100	21 325	+1 225	+6,1%
↑ Aprendere Skolor	1 936	12,8%	10,40	10,90	20 134	21 102	+968	+4,8%
↓ White Pearl Techno	3 357	12,1%	6,00	5,94	20 142	19 941	-201	-1,0%
↓ Fractal Gaming Gro	608	11,6%	33,10	31,60	20 125	19 213	-912	-4,5%
↓ Dedicare B	208	7,5%	96,50	59,70	20 072	12 418	-7 654	-38,1%
↓ SSAB B	248	7,5%	81,08	50,00	20 108	12 400	-7 708	-38,3%
↓ Starbreeze B	62 555	7,5%	0,32	0,20	20 143	12 392	-7 751	-38,5%
↓ Eolus Vind B	268	7,4%	74,90	45,50	20 073	12 194	-7 879	-39,3%
SUMMA		100,0%			188 869	165 052	-23 817	-12,6%

6. Stabil tillväxt + Momentum, årligt byte



	Utv 9 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt + Mom, år	-7%	-	-5%	-2%
OMXS GI	+7%	+20%	-3%	-4%

- Strategi startad 2024-02-29

6. Stabil tillväxt + Momentum, årligt byte

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
- SVENSKAAKTIER								
↑ MedCap	24	15,5%	403,00	548,00	9 672	13 152	+3 480	+36,0%
↑ Intellego Technolog	138	6,1%	29,00	37,75	4 002	5 210	+1 208	+30,2%
↑ Zinzino B	124	12,5%	80,40	85,30	9 970	10 577	+608	+6,1%
↑ Bredband2	5 302	12,2%	1,89	1,96	10 000	10 403	+403	+4,0%
↑ VBG Group B	36	12,1%	277,50	284,50	9 990	10 242	+252	+2,5%
↓ Volvo B	35	11,2%	285,10	272,40	9 979	9 534	-444	-4,5%
↓ Fortnox	138	10,9%	72,14	67,24	9 955	9 279	-676	-6,8%
↓ Munters Group AB	52	10,4%	189,30	169,90	9 844	8 835	-1 009	-10,2%
↓ Guideline Geo	675	6,3%	14,80	7,88	9 990	5 319	-4 671	-46,8%
↓ AQ Group	18	2,8%	556,00	132,24	10 008	2 380	-7 628	-76,2%
SUMMA		100,0%			93 409	84 930	-8 478	-9,1%

7. Stabil tillväxt + Momentum, byte varje kvartal

Momentum tillagt 2023-05-28



	Utv 4 år 9 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt + Mom, kv	+18%	+16%	+6%	-3%
OMXS GI	+71%	+20%	-3%	-4%

Observation, se pilar i diagrammet

- Från start till 2022-01-04, all time high, har portföljen gått 26% bättre än index, 97% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 28% sämre än index, portfölj -52% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-11-28 har portföljen gått 5% sämre än index, portfölj +27% och index +32%

7. Stabil tillväxt + Momentum, byte varje kvartal

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Paxman	222	13,1%	53,20	72,20	11 810	16 028	+4 218	+35,7%
↑ Plejd	43	12,9%	272,00	368,00	11 696	15 824	+4 128	+35,3%
↑ RaySearch Labora	75	12,7%	157,00	207,00	11 775	15 525	+3 750	+31,8%
↑ Verve Group	342	11,4%	34,50	41,00	11 799	14 022	+2 223	+18,8%
↑ Net Insight B	1 764	9,7%	6,70	6,77	11 819	11 942	+123	+1,0%
↑ MedCap	21	9,4%	543,00	548,00	11 403	11 508	+105	+0,9%
↓ AAK	37	8,9%	312,40	294,20	11 559	10 885	-673	-5,8%
↓ Proact IT Group	77	8,4%	152,00	134,40	11 704	10 349	-1 355	-11,6%
↓ CodeMill	671	8,4%	17,60	15,30	11 810	10 266	-1 543	-13,1%
↓ Envirologic B	428	5,2%	27,60	14,85	11 813	6 356	-5 457	-46,2%
SUMMA		100,0%			117 187	122 706	+5 519	+4,7%

8. Stabil tillväxt + F-Score, årligt byte



	Utv 6 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt + F-Score, år	+3	-	+4%	+2%
OMXS GI	-3%	+20%	-3%	-4%

- Strategi startad 2024-05-17

8. Stabil tillväxt + F-Score, årligt byte

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Intellego Technolog	365	13,7%	27,35	37,75	9 983	13 779	+3 796	+38,0%
↑ Truecaller	273	13,2%	36,62	48,60	9 997	13 268	+3 271	+32,7%
↑ Betsson B	83	11,9%	119,52	144,38	9 920	11 984	+2 063	+20,8%
↑ Systemair	121	11,0%	82,50	91,30	9 983	11 047	+1 065	+10,7%
↑ Zinzino B	121	10,3%	82,20	85,30	9 946	10 321	+375	+3,8%
↓ Camurus	17	9,3%	561,00	553,00	9 537	9 401	-136	-1,4%
↓ Evolution	8	7,8%	1 180,00	975,00	9 440	7 800	-1 640	-17,4%
↓ Fractal Gaming Gr	261	8,2%	38,30	31,60	9 996	8 248	-1 749	-17,5%
↓ Revolutionrace	192	7,4%	52,00	39,02	9 984	7 492	-2 492	-25,0%
↓ C-RAD B	250	7,2%	39,85	28,95	9 963	7 238	-2 725	-27,4%
SUMMA		100,0%			98 749	100 577	+1 828	+1,9%

9. Tio-i-topp

Portföljhantering - Ak kv: Tio-i-topp

Portföljutveckling, 28 nov 2021 - 28 nov 2024



Diagram	(slutkurs)	Period
- mot jämförelseindex		<...>
Jämfört föreg. dag:	-1,17%, -1 124 kr	
Aktuellt innehav		
Marknadsvärde:	95 036	
Kassa:	1 240	
Totalt:	96 276	
varav realiserad	+519	
Vinst/förlust, 28 nov 2021 - 28 nov		
Realiserad vinst:	+61 667	
Realiserad förlust:	-72 208	
Utdelning:	+6 298	
Total vinst/förlust:	-4 243	
☒ Inkludera kassa		

	Utv 3 år	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Tio-i-topp	-4%	+20%	+2%	-3%
OMXS GI	+6%	+20%	-3%	-4%

Observation, se pilar i diagrammet

- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 1% sämre än index, portfölj -25% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-11-28 har portföljen gått 12% sämre än index, portfölj +20% och index +32%
- När OMXSPI gått under MA200 läggs pengarna i kassan, horisontell linje i diagrammet enligt portföljstrategin

9. Tio-i-topp

Innehav, 2024-11-28

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Paxman	179	13,6%	53,20	72,20	9 523	12 924	+3 401	+35,7%
↑ Lundin Gold	45	12,1%	208,00	255,00	9 360	11 475	+2 115	+22,6%
↑ Verve Group	276	11,9%	34,50	41,00	9 522	11 316	+1 794	+18,8%
↑ Cloetta	420	11,5%	22,66	26,00	9 517	10 920	+1 403	+14,7%
↑ Ambea	109	11,0%	86,95	95,85	9 478	10 448	+970	+10,2%
↓ Hifab B	2 819	9,3%	3,38	3,12	9 528	8 795	-733	-7,7%
↓ Dedicare B	135	8,5%	70,40	59,70	9 504	8 060	-1 445	-15,2%
↓ B3 Consulting Gro	106	8,4%	89,40	75,00	9 476	7 950	-1 526	-16,1%
↓ Camurus	13	7,6%	699,50	553,00	9 094	7 189	-1 905	-20,9%
↓ Hexatronic Group	159	6,3%	59,84	37,48	9 515	5 959	-3 555	-37,4%
SUMMA		100,0%			94 516	95 036	+519	+0,5%