

Fokus detta aktiekafé:

- Avkastning, se sammanfattning sida 3

Uppföljning screeningstrategierna

Utveckling 2024-12-31

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	58	+64%	10,8 %/år	-4%	+14%	+14%	-3%	-1%
2. Magic formula + Mom, byte år	58	+63%	10,6 %/år	+8%	-7%	-7%	-8%	+1%
3. F-Score, byte år	58	+54%	9,3 %/år	-2%	-4%	-4%	-2%	-1%
4. F-Score + Mom, byte kv	58	+129%	18,7 %/år	-8%	+10%	+10%	-9%	-1%
5. Stabil tillväxt, byte år	58	+83%	13,3 %/år	+16%	-25%	-25%	-3%	+1%
6. Stabil tillväxt + Momentum, byte år	10	0%	0 %/år	-	-	-	+1%	+4%
7. Stabil tillväxt + Mom, byte kv	58	+19%	3,7 %/år	-4%	+8%	+8%	0%	0%
8. Stabil tillväxt + F-Score, byte år	7	+5%	8,7 %/år	-	-	-	+4%	0%
9. Tio-i-topp	37	-4%	-1,3 %/år	+2%	+7%	+7%	-1%	0%
Index OMXSGI från 2020-02-28	58	+70%	11,6 %/år					
Index OMXSGI från 2021-11-30	37	+5%	1,6 %/år					
Index OMXSGI från 2024-02-28	10	+6%	7,2 %/år					
Index OMXSGI från 2024-05-17	7	-3%	-5,1 %/år					
Index OMXSGI				+19%	+9%	+9%	-6%	-1%

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 10 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Greenblatt	+64%	+14%	-3%	-1%
OMXS GI	+70%	+9%	-6%	-1%

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 2024-12-31 har portföljen gått 4% bättre än index, portfölj +35% och index +31%

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

Innehav, 2024-12-31									
Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt värde	+/-	% ▼	
[-] SVENSKA AKTIER									
↑ Verve Group	647	15,0%	19,20	35,75	12 422	23 130	+10 708	+86,2%	
↑ Intellego Technologies	278	7,4%	24,40	41,00	6 783	11 398	+4 615	+68,0%	
↑ Betsson B	66	6,1%	102,40	143,60	6 758	9 478	+2 719	+40,2%	
↑ VBG Group B	15	3,0%	289,50	312,00	4 343	4 680	+338	+7,8%	
↑ Novotek B	180	8,6%	68,80	73,40	12 384	13 212	+828	+6,7%	
↑ Veteranpoolen B	186	4,7%	36,80	38,80	6 845	7 217	+372	+5,4%	
↑ Revolutionrace	112	3,0%	39,54	40,98	4 428	4 590	+161	+3,6%	
↓ C-RAD B	147	2,9%	30,25	30,00	4 447	4 410	-37	-0,8%	
↓ Softronic B	294	4,3%	23,10	22,55	6 791	6 630	-162	-2,4%	
↓ Nilörngruppen B	65	2,8%	67,80	65,80	4 407	4 277	-130	-2,9%	
↓ Zinzino B	50	2,7%	88,70	84,60	4 435	4 230	-205	-4,6%	
↓ Volvo B	23	4,0%	285,10	268,60	6 557	6 178	-380	-5,8%	
↓ Lundin Gold	17	2,6%	251,00	233,50	4 267	3 970	-298	-7,0%	
↓ Berner Industrier B	327	7,1%	38,00	33,70	12 426	11 020	-1 406	-11,3%	
↓ Nordrest	53	3,8%	128,40	109,20	6 805	5 788	-1 018	-15,0%	
↓ Volvo Car B	229	3,6%	29,92	23,98	6 852	5 491	-1 360	-19,9%	
↓ ProfilGruppen B	99	6,4%	125,00	99,20	12 375	9 821	-2 554	-20,6%	
↓ Gentoo Media	399	6,4%	31,15	24,65	12 429	9 835	-2 594	-20,9%	
↓ Eolus Vind B	109	3,4%	62,80	48,00	6 845	5 232	-1 613	-23,6%	
↓ SSAB B	83	2,4%	81,08	43,91	6 730	3 645	-3 085	-45,8%	
SUMMA		100,0%			149 330	154 230	+4 900	+3,3%	

2. Magic Formula + Momentum, årligt byte



	Utv 4 år 10 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
MF+Mom, år	+63%	-7%	-8%	+1%
OMXSGI	+70%	+9%	-6%	-1%

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 2024-12-31 har portföljen gått 13% sämre än index, portfölj +18% och index +31%

2. Magic Formula + Momentum, årligt byte

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Verve Group	421	8,3%	19,20	35,75	8 083	15 051	+6 968	+86,2%
↑ Intellego Technolog	748	17,0%	24,40	41,00	18 251	30 668	+12 417	+68,0%
↑ Arla Plast	457	11,9%	39,90	46,90	18 234	21 433	+3 199	+17,5%
↑ VBG Group B	65	11,2%	277,50	312,00	18 038	20 280	+2 243	+12,4%
↑ Zinzino B	227	10,6%	80,40	84,60	18 251	19 204	+953	+5,2%
↑ Berner Industrier B	556	10,4%	32,80	33,70	18 237	18 737	+500	+2,7%
↓ Volvo B	64	9,5%	285,10	268,60	18 246	17 190	-1 056	-5,8%
↓ Envirologic B	945	8,0%	19,30	15,20	18 239	14 364	-3 874	-21,2%
↓ Combinedx	396	7,0%	46,00	32,10	18 216	12 712	-5 504	-30,2%
↓ Guideline Geo	1 233	5,9%	14,80	8,68	18 248	10 702	-7 546	-41,4%
SUMMA		100,0%			172 043	180 342	+8 299	+4,8%

3. F-Score, årligt byte



	Utv 4 år 10 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
F-Score, år	+54%	-4%	-2%	-1%
OMXSGI	+70%	+9%	-6%	-1%

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 2024-12-31 har portföljen gått 18% sämre än index, portfölj +13% och index +31%

3. F-Score, årligt byte

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ RaySearch Labora	155	20,5%	99,30	216,00	15 392	33 480	+18 089	+117,5%
↑ Lundin Gold	130	18,5%	118,60	233,50	15 418	30 355	+14 937	+96,9%
↑ Cloetta	863	13,3%	17,88	25,20	15 430	21 748	+6 317	+40,9%
↑ VBG Group B	55	10,5%	277,50	312,00	15 263	17 160	+1 898	+12,4%
↑ Fractal Gaming Gr	466	9,6%	33,10	33,60	15 425	15 658	+233	+1,5%
↓ Formpipe Software	532	7,4%	29,00	22,90	15 428	12 183	-3 245	-21,0%
↓ Combinedx	335	6,6%	46,00	32,10	15 410	10 754	-4 657	-30,2%
↓ Drillcon	2 360	6,4%	6,54	4,45	15 434	10 502	-4 932	-32,0%
↓ QleanAir	496	4,9%	31,10	16,20	15 426	8 035	-7 390	-47,9%
↓ AQ Group	27	2,3%	556,00	140,00	15 012	3 780	-11 232	-74,8%
SUMMA		100,0%			153 637	163 654	+10 017	+6,5%

4. F-Score + Momentum, byte varje kvartal



	Utv 4 år 10 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
F-Score + Mom, kv	+129%	+10%	-9%	-1%
OMXS GI	+70%	+9%	-6%	-1%

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 2024-12-31 har portföljen gått 4% sämre än index, portfölj +27% och index +31%

4. F-Score + Momentum, byte varje kvartal

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Dynavox Group	466	10,8%	58,60	62,60	27 308	29 172	+1 864	+6,8%
↑ Clas Ohlson B	138	10,8%	197,00	210,00	27 186	28 980	+1 794	+6,6%
↑ RaySearch Labora	131	10,5%	208,00	216,00	27 248	28 296	+1 048	+3,8%
↑ Millicom Internation	102	10,3%	265,40	271,20	27 071	27 662	+592	+2,2%
↓ Securitas B	198	10,1%	137,95	136,90	27 314	27 106	-208	-0,8%
↓ Plejd	72	9,9%	374,50	370,00	26 964	26 640	-324	-1,2%
↓ Premium Snacks N	1 526	9,9%	17,90	17,40	27 315	26 552	-763	-2,8%
↓ Lundin Gold	108	9,4%	251,00	233,50	27 108	25 218	-1 890	-7,0%
↓ Softronic B	1 122	9,4%	24,35	22,55	27 321	25 301	-2 020	-7,4%
↓ Paxman	366	8,9%	74,60	65,60	27 304	24 010	-3 294	-12,1%
SUMMA		100,0%			272 138	268 937	-3 201	-1,2%

5. Stabil tillväxt, årligt byte



	Utv 4 år 10 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt, år	+83%	-25%	-3%	+1%
OMXSGI	+70%	+9%	-6%	-1%

Observation, se pilar i diagrammet

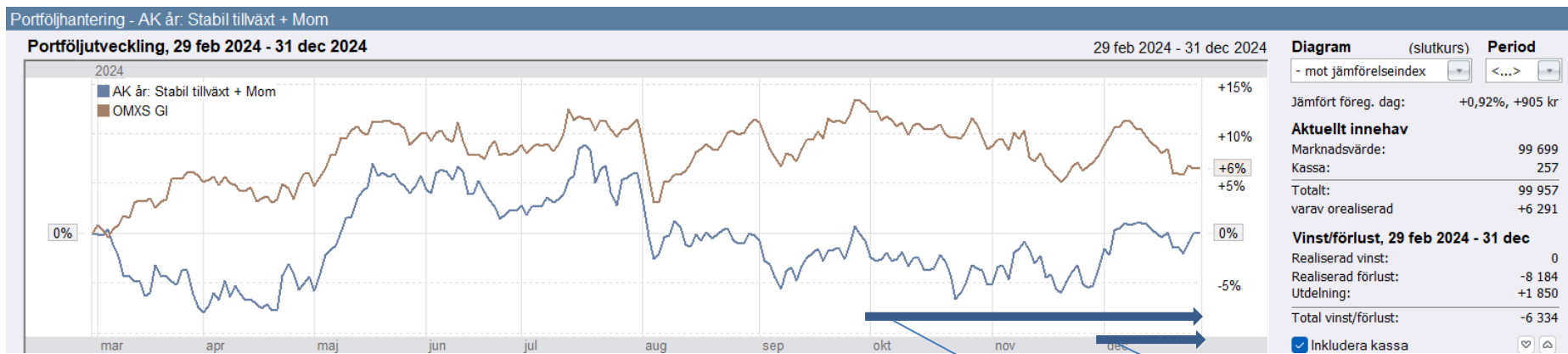
- Från start till 2022-01-04, all time high, har portföljen gått 85 bättre än index, 156% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 4% sämre än index, portfölj -28% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-12-31 har portföljen gått 32% sämre än index, portfölj -1% och index +31%

5. Stabil tillväxt, årligt byte

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Intellego Technolog	270	6,6%	29,00	41,00	7 830	11 070	+3 240	+41,4%
↑ Hexatronic Group	637	13,8%	31,62	36,18	20 142	23 047	+2 905	+14,4%
↑ Aprendere Skolor	1 936	13,2%	10,40	11,40	20 134	22 070	+1 936	+9,6%
↑ Zinzino B	250	12,7%	80,40	84,60	20 100	21 150	+1 050	+5,2%
↑ White Pearl Techno	3 357	12,4%	6,00	6,18	20 142	20 746	+604	+3,0%
↑ Fractal Gaming Gro	608	12,2%	33,10	33,60	20 125	20 429	+304	+1,5%
↓ Starbreeze B	62 555	7,8%	0,32	0,21	20 143	13 112	-7 031	-34,9%
↓ Eolus Vind B	268	7,7%	74,90	48,00	20 073	12 864	-7 209	-35,9%
↓ Dedicare B	208	7,0%	96,50	56,60	20 072	11 773	-8 299	-41,3%
↓ SSAB B	248	6,5%	81,08	43,91	20 108	10 890	-9 218	-45,8%
SUMMA		100,0%			188 869	167 150	-21 719	-11,5%

6. Stabil tillväxt + Momentum, årligt byte



	Utv 10 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt + Mom, år	0%	-	+1%	+4%
OMXS GI	+6%	+9%	-6%	-1%

- Strategi startad 2024-02-29

6. Stabil tillväxt + Momentum, årligt byte

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
SVENSKAAKTIER								
↑ MedCap	24	14,5%	403,00	601,00	9 672	14 424	+4 752	+49,1%
↑ Intellego Technolog	138	5,7%	29,00	41,00	4 002	5 658	+1 656	+41,4%
↑ AQ Group	90	12,6%	111,20	140,00	10 008	12 600	+2 592	+25,9%
↑ VBG Group B	36	11,3%	277,50	312,00	9 990	11 232	+1 242	+12,4%
↑ Zinzino B	124	10,5%	80,40	84,60	9 970	10 490	+521	+5,2%
↑ Bredband2	5 302	10,4%	1,89	1,96	10 000	10 413	+414	+4,1%
↓ Fortnox	138	10,0%	72,14	72,10	9 955	9 950	-6	-0,1%
↓ Munters Group AB	52	9,7%	189,30	186,00	9 844	9 672	-172	-1,7%
↓ Volvo B	35	9,4%	285,10	268,60	9 979	9 401	-578	-5,8%
↓ Guideline Geo	675	5,9%	14,80	8,68	9 990	5 859	-4 131	-41,4%
SUMMA		100,0%			93 409	99 699	+6 291	+6,7%

7. Stabil tillväxt + Momentum, byte varje kvartal

Momentum tillagt 2023-05-28



	Utv 4 år 10 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt + Mom, kv	+19%	+8%	0%	0%
OMXS GI	+70%	+9%	-6%	-1%

Observation, se pilar i diagrammet

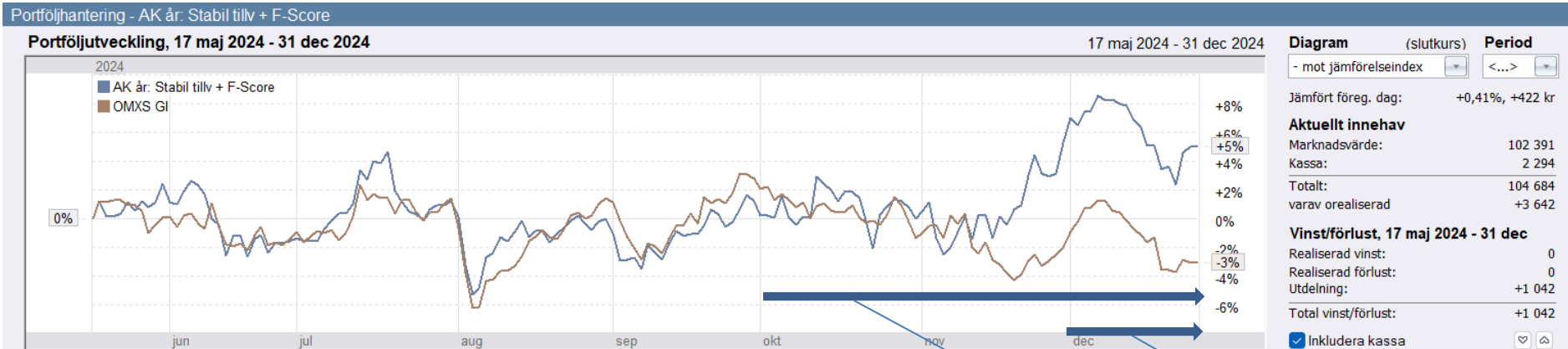
- Från start till 2022-01-04, all time high, har portföljen gått 26% bättre än index, 97% vs 71% för index
- Från 2022-01-04 till 2023-10-27 har portföljen gått 28% sämre än index, portfölj -52% och index -24%
- Från 2023-10-27 till 2024-12-31 har portföljen gått 3% sämre än index, portfölj +28% och index +31%

7. Stabil tillväxt + Momentum, byte varje kvartal

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ MedCap	22	11,9%	551,00	601,00	12 122	13 222	+1 100	+9,1%
↑ Net Insight B	1 767	11,9%	7,01	7,53	12 387	13 306	+919	+7,4%
↑ Fortnox	181	11,7%	68,10	72,10	12 326	13 050	+724	+5,9%
↑ RaySearch Labora	59	11,4%	208,00	216,00	12 272	12 744	+472	+3,8%
↓ Intellego Technolog	299	11,0%	41,40	41,00	12 379	12 259	-120	-1,0%
↓ Plejd	33	11,0%	374,50	370,00	12 359	12 210	-149	-1,2%
↓ Premium Snacks Ni	692	10,8%	17,90	17,40	12 387	12 041	-346	-2,8%
↓ Zinzino B	139	10,5%	88,70	84,60	12 329	11 759	-570	-4,6%
↓ Paxman	166	9,8%	74,60	65,60	12 384	10 890	-1 494	-12,1%
SUMMA		100,0%			110 944	111 480	+537	+0,5%

8. Stabil tillväxt + F-Score, årligt byte



	Utv 7 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Stabil tillväxt + F-Score, år	+5	-	+4%	0%
OMXSGI	-3%	+9%	-6%	-1%

- Strategi startad 2024-05-17

8. Stabil tillväxt + F-Score, årligt byte

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼
[-] SVENSKAAKTIER								
↑ Intellego Technolog	365	14,6%	27,35	41,00	9 983	14 965	+4 982	+49,9%
↑ Truecaller	273	13,6%	36,62	51,15	9 997	13 964	+3 967	+39,7%
↑ Betsson B	83	11,6%	119,52	143,60	9 920	11 919	+1 999	+20,1%
↑ Systemair	121	10,5%	82,50	88,70	9 983	10 733	+750	+7,5%
↑ Zinzino B	121	10,0%	82,20	84,60	9 946	10 237	+290	+2,9%
↑ Camurus	17	9,4%	561,00	565,50	9 537	9 614	+77	+0,8%
↓ Fractal Gaming Gr	261	8,6%	38,30	33,60	9 996	8 770	-1 227	-12,3%
↓ Revolutionrace	192	7,7%	52,00	40,98	9 984	7 868	-2 116	-21,2%
↓ C-RAD B	250	7,3%	39,85	30,00	9 963	7 500	-2 463	-24,7%
↓ Evolution	8	6,7%	1 180,00	852,80	9 440	6 822	-2 618	-27,7%
SUMMA		100,0%			98 749	102 391	+3 642	+3,7%

9. Tio-i-topp



	Utv 3 år 1 mån	Utv 1 år	Utv 3 mån	Utv 1 mån
Tio-i-topp	-4%	+7%	-1%	0%
OMXS GI	+5%	+9%	-6%	-1%

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 2024-12-31 har portföljen gått 11% sämre än index, portfölj +20% och index +31%
- När OMXSPI gått under MA200 läggs pengarna i kassan, horisontell linje i diagrammet enligt portföljstrategin

9. Tio-i-topp

Innehav, 2024-12-31

Namn	Antal	Andel	Köpsnitt	Aktuell kurs	Inköpspris	Aktuellt ...	+/-	% ▼

Pengarna ligger i kassan