

Avkastning Börslabbets strategier 2020

Alla siffror är endast prisutveckling (alltså exklusive utdelningar).

Sverige

Årvis ombalansering (1:a mars)

OMXSPI +12,9 %

Topp 10:

Trendande värde	Trendande kvalitet	Trendande utdelning	Snitt
21,5 %	38,3 %	9,6 %	32,7 %

Topp 40 primära faktorer:

Värde	Kvalitet	Utdelning	Snitt
17,7 %	34,5 %	2,8 %	20,9 %

Kvartalsvis ombalansering efter säsongsmönster

Topp 10:

Trendande värde	Trendande kvalitet	Trendande utdelning	Sammansatt momentum	Snitt
-3,6 %	8,0 %	0,0 %	85,4 %	19,7 %

Topp 40 primära faktorer:

Värde	Kvalitet	Utdelning	Momentum	Snitt
12,4 %	13,7 %	1,7 %	29,2 %	14,3 %

Norden

Ej justerat för valutaändringar. OMX Nordic SEK PI +15,0 %

Årvis ombalansering (1:a mars)

Topp 10:

Trendande värde	Trendande kvalitet	Trendande utdelning	Snitt
25,0 %	34,6 %	12,6 %	40,3 %

Topp 40 primära faktorer:

Värde	Kvalitet	Utdelning	Snitt
12,9 %	37,9 %	14,4 %	21,7 %

Kvartalsvis ombalansering efter säsongsmönster

Topp 10:

Trendande värde	Trendande kvalitet	Trendande utdelning	Sammansatt momentum	Snitt
17,2 %	22,8 %	-4,8 %	90,4 %	29,2 %

Topp 40 primära faktorer:

Värde	Kvalitet	Utdelning	Momentum	Snitt
22,7 %	29,0 %	1,5 %	49,0 %	24,9 %

USA

S&P 500: +16,3 %

Topp 20 ombalansering årsskifte:

Trendande värde	Sammansatt värde	EV/EBIT	Sammansatt momentum
17,6 %	-7,4 %	-22,5 %	18,6 %