

inverde

Aktiemarknadens faktorer - historik

2026-03-31

Historisk avkastning är ingen garanti

Investeringar i värdepapper innebär alltid en risk. En investering kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka det investerade kapitalet. Historisk avkastning är ingen garanti för avkastning i framtiden.

Läs mer på kund.inverde.se, välj kundbrev och ett av de äldsta inläggen med rubriken: '*Historisk avkastning är ingen garanti*'.

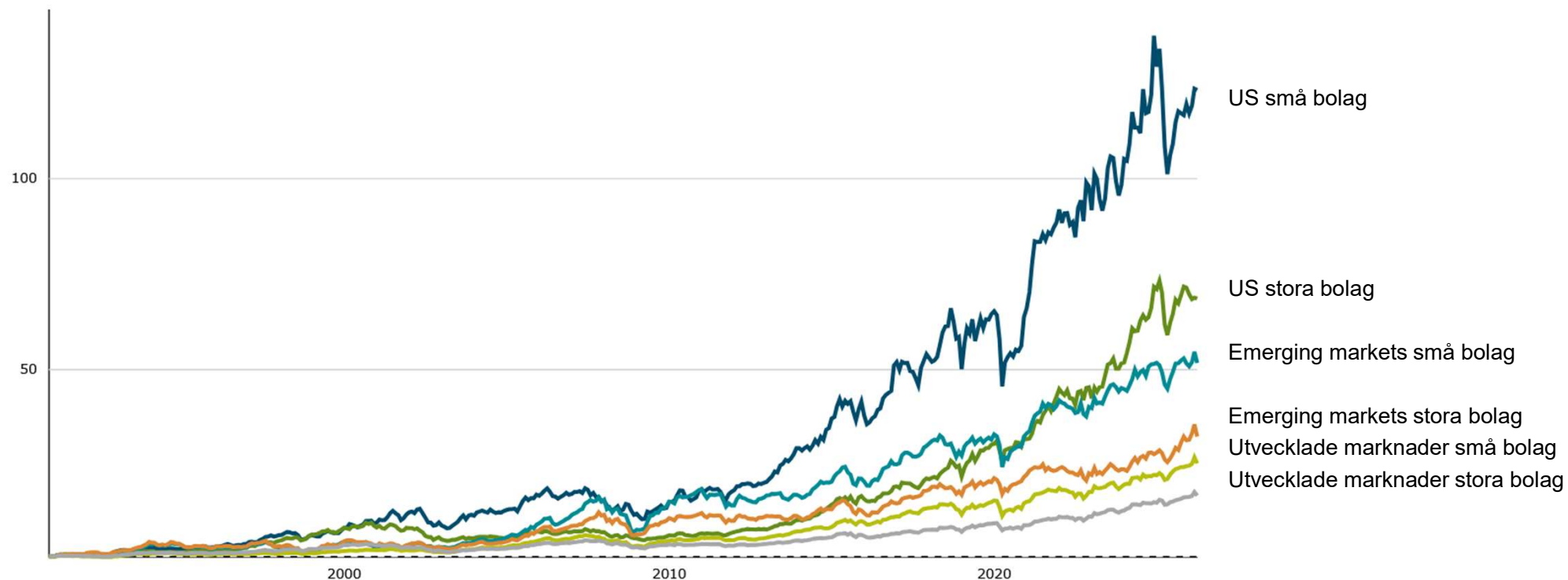
Avkastning faktorer över tid



Källa: Inverde, Dimensional Fund Advisors, årlig genomsnittlig avkastning i USD

Avkastning – småbolag vs stora bolag

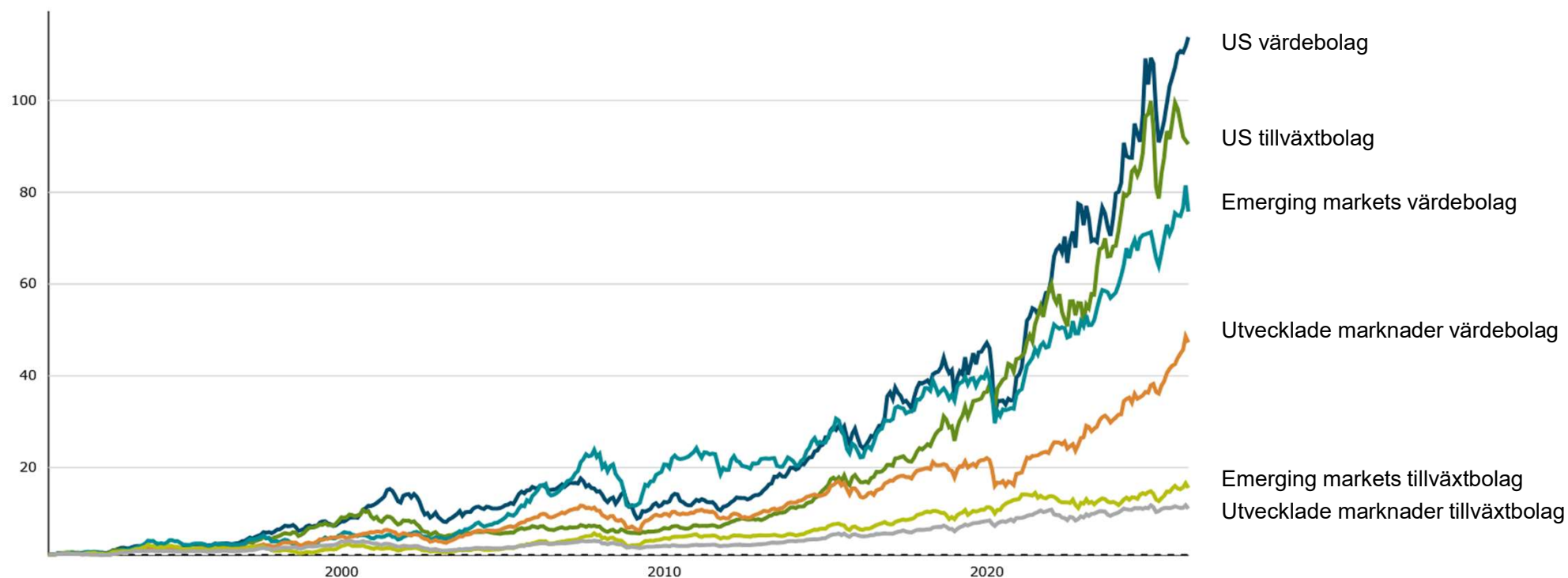
Monthly: 1/12/1990 - 31/3/2026
Converted SEK using New York Close Rates



Källa: Inverde, Dimensional Fund Advisors. Indexbeskrivning se Definitioner och Index.

Avkastning – värdebolag vs tillväxtbolag

Monthly: 1/12/1990 - 31/3/2026
Converted SEK using New York Close Rates

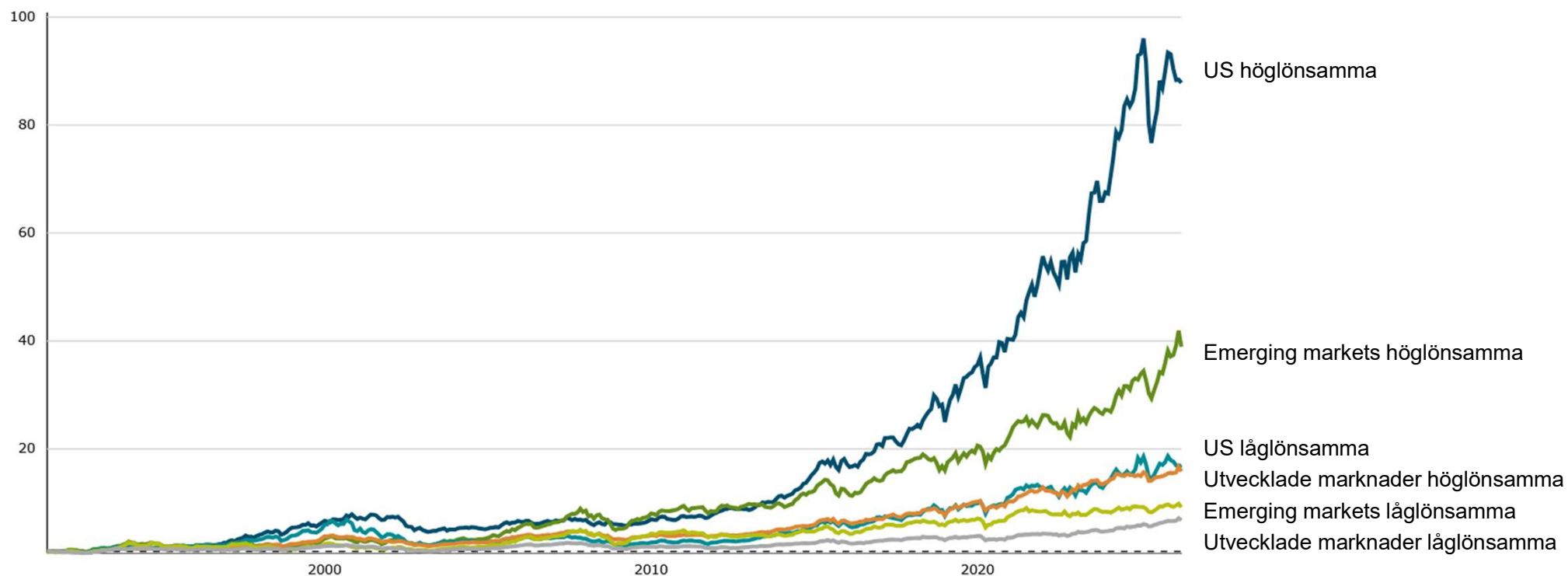


Källa: Inverde, Dimensional Fund Advisors. Indexbeskrivning se Definitioner och Index.

inverde

Avkastning – hög vs låglönsamma bolag

Monthly: 1/7/1991 - 31/3/2026
Converted SEK using New York Close Rates



Källa: Inverde, Dimensional Fund Advisors. Indexbeskrivning se Definitioner och Index.

Avkastning - faktorer vs index

Monthly: 1/12/1990 - 31/3/2026
Converted SEK using New York Close Rates



Källa: Inverde, Dimensional Fund Advisors. Indexbeskrivning se Definitioner och Index.

Definitioner och index

Små bolag: Småbolag definieras som de minsta 10% av alla bolag (8-15% beroende på marknad) i ett land baserat på free-float market cap.

Värdebolag: Värdebolag är de 30-33% av ett lands noterade bolag som har lägst P/BV (aktiepris relativt bolagets egna kapital per aktie baserat på rullande historiska data).

Lönsamma bolag: Lönsamhet definieras som EBITDA minus räntekostnader / bolagets egna kapital (rullande historiska data)

Index: Nedanstående index används i graferna avseende småbolag, värdebolag och lönsamma bolag, samtliga i SEK

Dimensional US Small Cap Index

S&P 500 Index

Dimensional International Small Cap Index

MSCI World ex USA Index (gross div.)

Dimensional Emerging Markets Small Index

MSCI Emerging Markets Index (gross div.)

Fama/French US Value Research Index

Fama/French US Growth Research Index

Fama/French International Value Index

Fama/French International Growth Index

Fama/French Emerging Markets Value Index

Fama/French Emerging Markets Growth Index

Fama/French US High Profitability Index

Fama/French US Low Profitability Index

Fama/French International High Profitability Index

Fama/French International Low Profitability Index

Fama/French Emerging Markets High Profitability Index

Fama/French Emerging Markets Low Profitability Index