

AMF Fonder AB - Månadsrapport

per 2021-06-30

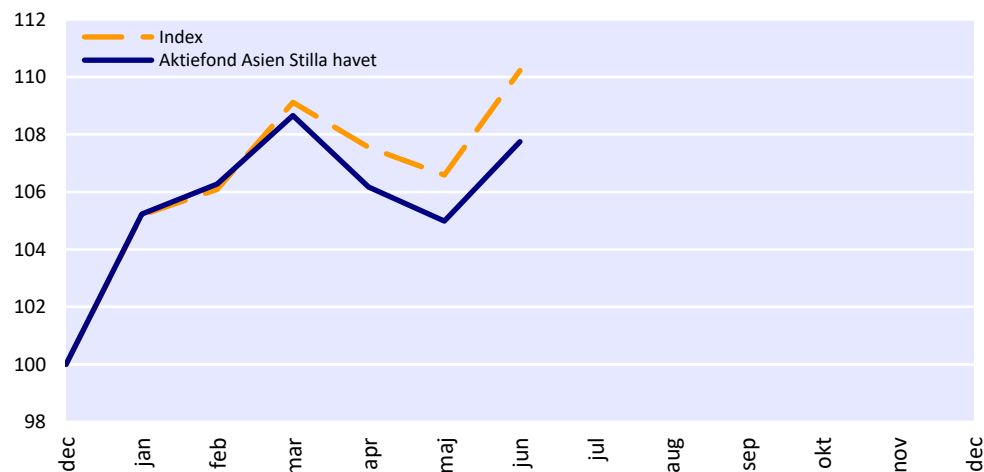


AMF Fonder AB, 113 88 Stockholm
Besöksadress: Klara Södra Kyrkogata 18
Telefon 08-696 31 00
www.amf.se
Org nr 556549-2922 Bolagets säte: Stockholm

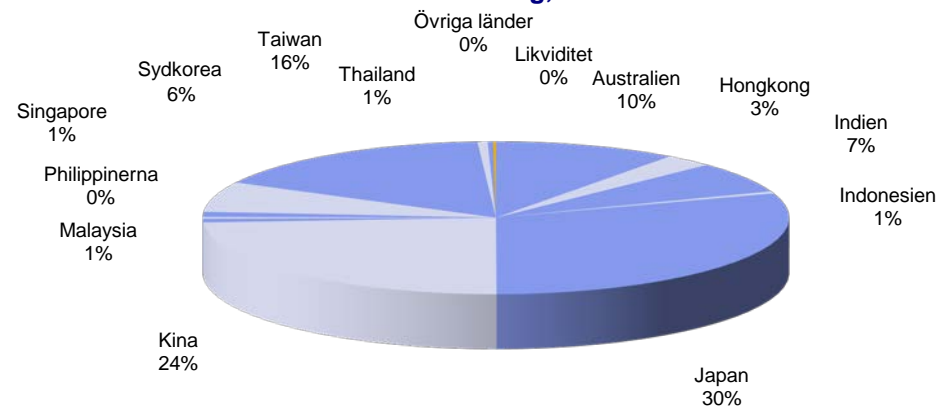
AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Asien och Stillahavsområdet.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Aktiefond Asien Stilla havet
Länderfördelning, %



Aktiefond Asien Stilla havet	
Totalt antal andelar	7 460 319
Total förmögenhet MSEK	2 162,4
Likviditet *	0,2%
Avkastning från årets början	7,75%
Avkastning Index	10,22%
Nav-kurs	289,86

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	8,6
Alibaba Group Holding, Kina	7,0
Tencent Holdings, Kina	6,1
Sony, Japan	3,8
HK Exch .& Cl., Hong Kong	2,6

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Mediatek, Taiwan	2,3
Shin-Etsu Chemical, Japan	2,1
Murata Manufacturing, Japan	2,1
Commenwealth Bank, Australia	2,0
Sumitomo Mitau Financial, Japan	1,9
Totalt	38,4

Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Asia Pacific NR (omräkn.sek)

AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Perioden 160630-210630 (5 år)*

Marknadsvärde (MSEK) 2 162,4

Avkastning - portfölj 90,8%

Avkastning - index 86,7%

Skillnad 4,2%

Riskindikator 6

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating ** 5

Volatilitet - portfölj 12,0%

Volatilitet - index 12,1%

Aktiv risk 1,4%

Info. Kvot 0,35

Sharpekvot - portfölj 1,20

Jensens alfa 0,7%

Beta 0,99

Förklaringsgrad 98,6%

Konsistens 56,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	2 162,4	1 801,9	1 305,1	918,9	979,3	1 584,8	1 319,4

Avkastning - portfölj	7,7%	12,3%	28,3%	-5,6%	17,2%	11,1%	6,5%
-----------------------	------	-------	-------	-------	-------	-------	------

Avkastning - index	10,2%	6,4%	28,5%	-6,8%	17,6%	13,1%	8,1%
--------------------	-------	------	-------	-------	-------	-------	------

Skillnad	-2,5%	5,9%	-0,2%	1,1%	-0,3%	-2,0%	-1,6%
----------	-------	------	-------	------	-------	-------	-------

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	2,6%	-0,8%	7,7%	24,2%	39,6%	90,8%	9,5%
Avkastning - index	3,4%	1,0%	10,2%	23,5%	34,3%	86,7%	10,0%
Skillnad	-0,8%	-1,9%	-2,5%	0,7%	5,3%	4,2%	-0,5%

Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Asia Pacific NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

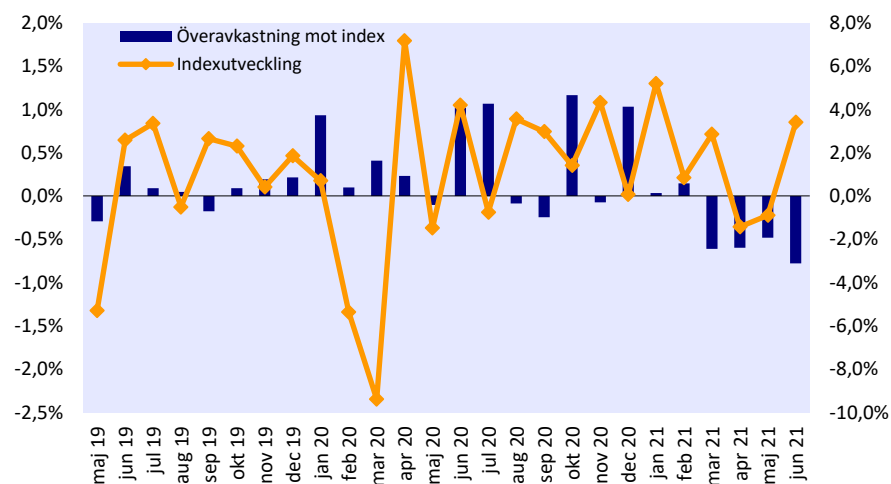
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

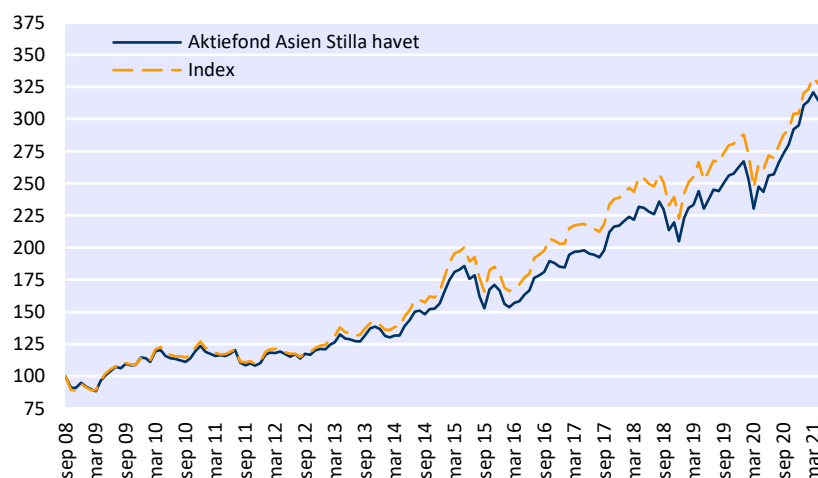
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



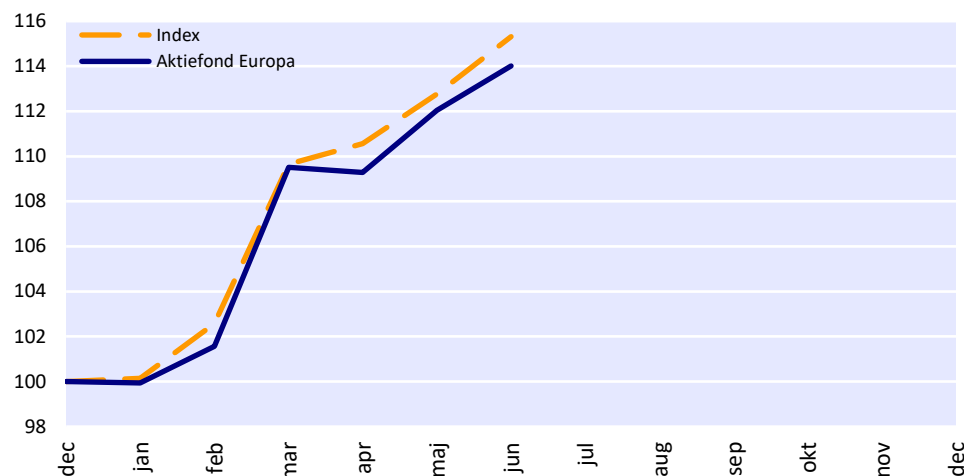
Utveckling fond vs index



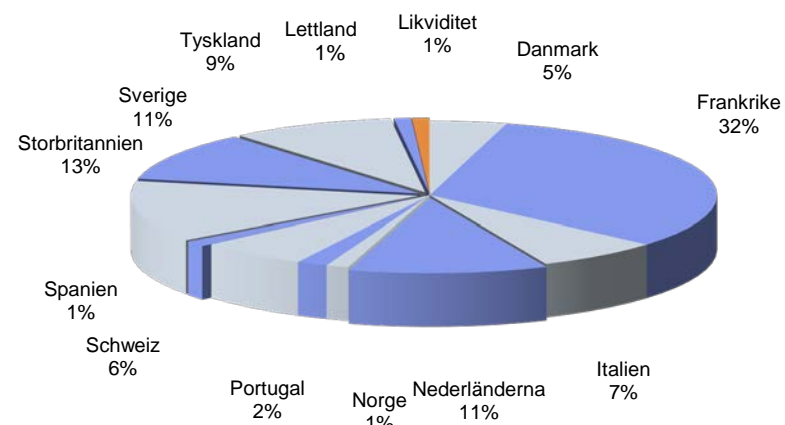
AMF AKTIEFOND EUROPA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Europa.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Aktiefond Europa
Länderfördelning, %



Aktiefond Europa	
Totalt antal andelar	24 704 569
Total förmögenhet MSEK	6 511,0
Likviditet *	1,0%
Avkastning från årets början	14,01%
Avkastning Index	15,31%
Nav-kurs	263,56

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Saint Gobain, Frankrike	4,1
Vivendi, Frankrike	4,0
Roche, Schweiz	3,9
Enel, Italien	3,5
GlaxoSmithkline, Storbritannien	3,1

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
SAP, Tyskland	3,0
Danone, Frankrike	2,7
Unilever, Nederländerna	2,6
Publicis, Frankrike	2,6
Michelin, Nederländerna	2,6
Totalt	32,0

Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Europe NR (omräkn.sek)

AMF AKTIEFOND EUROPA

Perioden 160630-210630 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	6 511,0
Avkastning - portfölj	72,9%
Avkastning - index	67,9%
Skillnad	5,0%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	14,2%
Volatilitet - index	13,8%
Aktiv risk	2,3%
Info. kvot	0,28
Sharpekvot - portfölj	0,85
Jensens alfa	0,4%
Beta	1,02
Förklaringsgrad	97,4%
Konsistens	61,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	6 511,0	5 480,6	5 611,9	4 362,4	5 558,7	4 162,5	4 157,7
Avkastning - portfölj	14,0%	1,1%	29,6%	-8,9%	12,1%	7,0%	6,4%
Avkastning - index	15,3%	-4,8%	32,5%	-6,2%	11,8%	5,6%	4,7%
Skillnad	-1,3%	5,9%	-2,8%	-2,7%	0,3%	1,4%	1,8%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	1,8%	4,1%	14,0%	25,2%	32,5%	72,9%	6,4%
Avkastning - index	2,3%	5,2%	15,3%	21,9%	29,1%	67,9%	4,8%
Skillnad	-0,5%	-1,1%	-1,3%	3,4%	3,4%	5,0%	1,5%

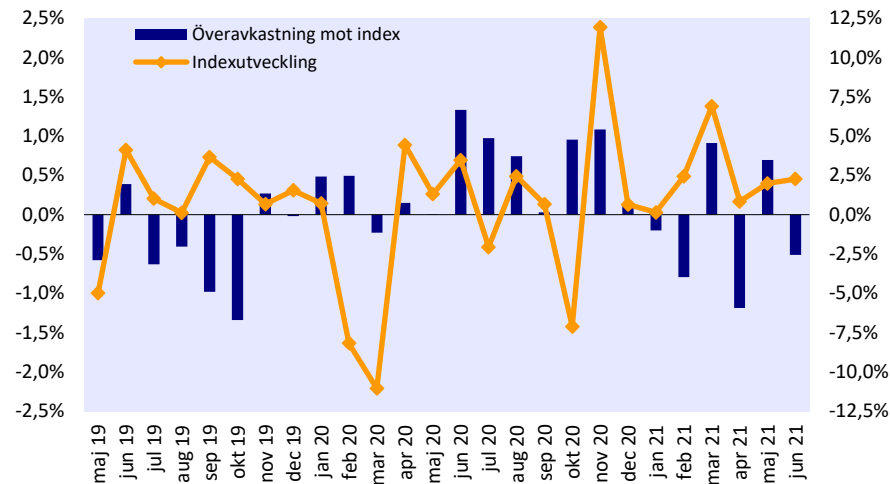
Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Europe NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

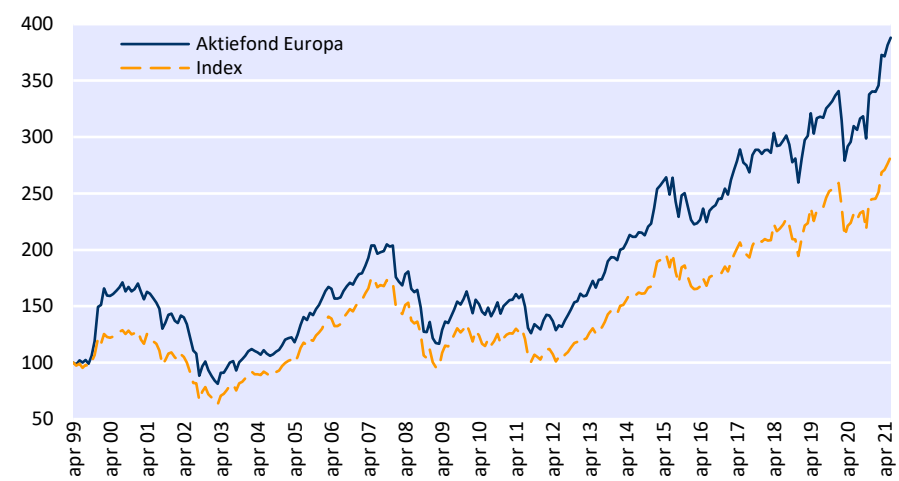
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



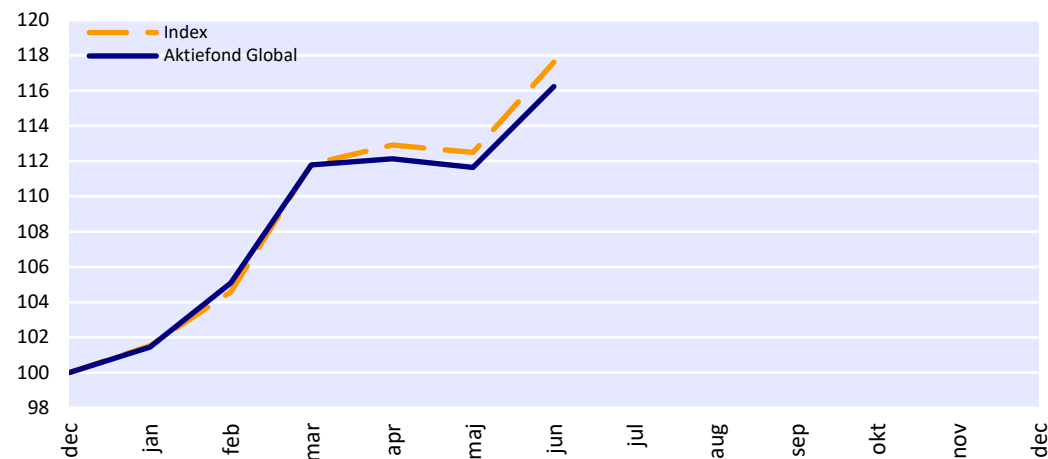
Utveckling fond vs index



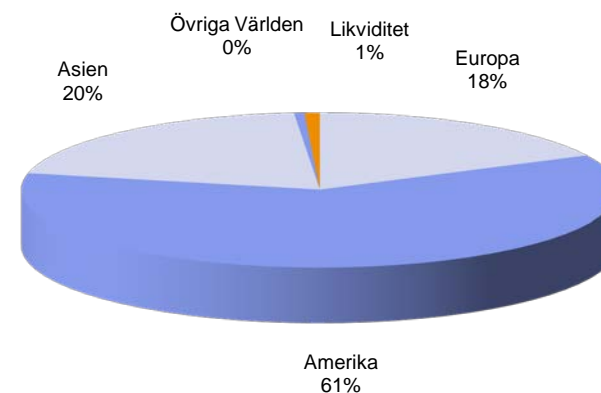
AMF AKTIEFOND GLOBAL

Fonden placerar huvudsakligen i utländska marknadsnoterade aktier. Fonden kan placera i aktier noterade på alla större börser i världen, men har för närvarande fokuserat placeringarna till USA och Europa.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Aktiefond Global
Länderfördelning, %



Aktiefond Global	
Totalt antal andelar	92 355 004
Total förmögenhet MSEK	23 669,6
Likviditet *	0,8%
Avkastning från årets början	16,24%
Avkastning Index	17,62%
Nav-kurs	256,29

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders NR (omräkn.sek)

Största aktieinnehav	Portfoljandel, %
Microsoft, USA	7,0
Alphabet, USA	6,0
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	2,3
Alibaba Group Holding, Kina	2,0
Procter & Gamble, USA	1,7

Största aktieinnehav	Portfoljandel, %
Nvidia, USA	1,6
Visa, USA	1,5
Merck & Co, USA	1,5
Salesforce, USA	1,3
Tesla, USA	1,3
Totalt	26,1

AMF AKTIEFOND GLOBAL

Perioden 160630-210630 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	23 669,6

Avkastning - portfölj	103,5%
Avkastning - index	99,9%
<i>Skillnad</i>	3,6%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	12,5%
Volatilitet - index	13,3%
Aktiv risk	1,6%
Info. kvot	0,26
Sharpekvot - portfölj	1,26
Jensens alfa	1,4%
Beta	0,94
Förklaringsgrad	98,9%
Konsistens	48,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	23 669,6	19 221,8	17 424,4	3 657,2	3 522,8	3 188,1	2 507,6

Avkastning - portfölj	16,2%	5,2%	34,7%	-1,1%	10,1%	15,6%	6,7%
Avkastning - index	17,6%	1,8%	34,3%	-1,1%	10,9%	16,2%	5,6%
<i>Skillnad</i>	-1,4%	3,5%	0,4%	0,0%	-0,8%	-0,6%	1,1%

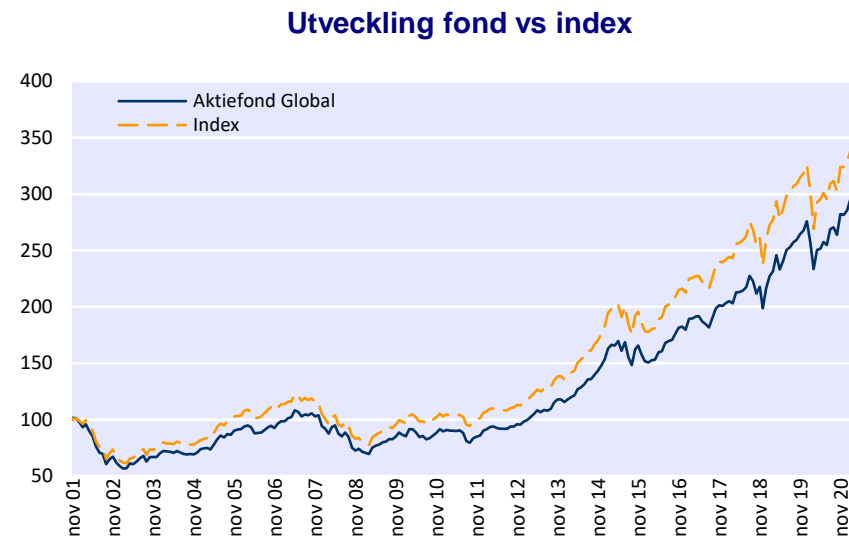
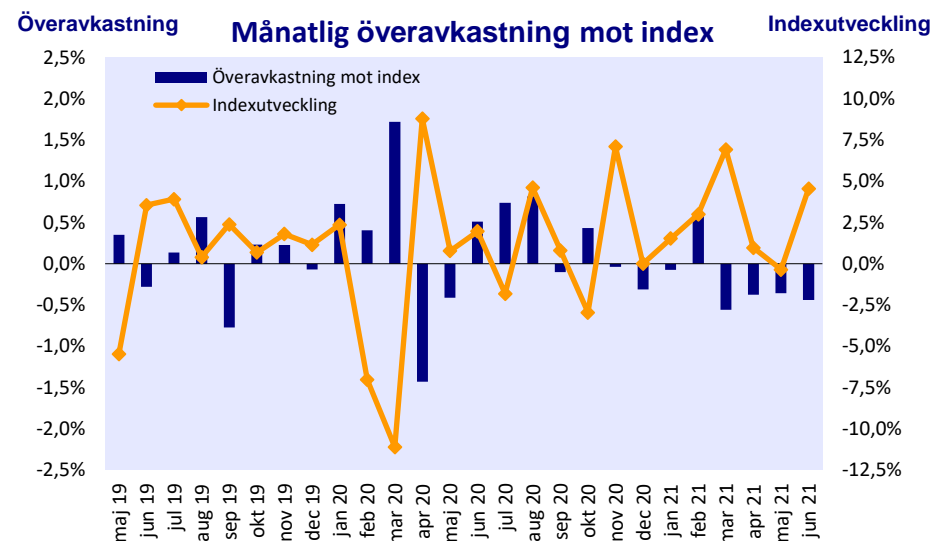
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	4,1%	4,0%	16,2%	27,0%	52,6%	103,5%	6,2%
Avkastning - index	4,5%	5,2%	17,6%	26,6%	47,1%	99,9%	7,1%
<i>Skillnad</i>	-0,4%	-1,2%	-1,4%	0,4%	5,5%	3,6%	-0,8%

Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

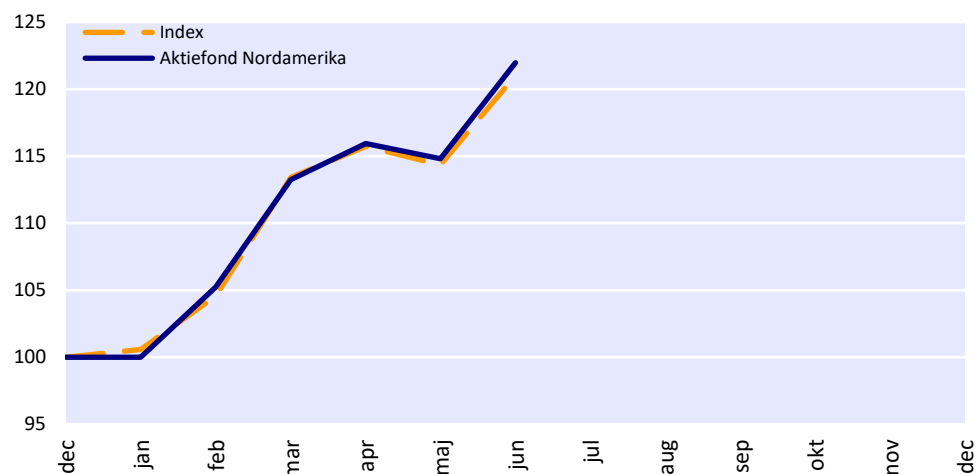
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



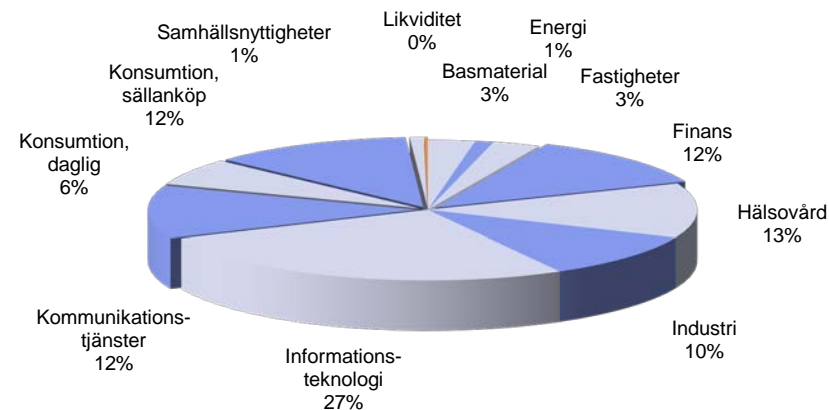
AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Nordamerika, framförallt i USA.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Aktiefond Nordamerika
branschfördelning, %



Aktiefond Nordamerika	
Totalt antal andelar	8 898 423
Total förmögenhet MSEK	3 605,7
Likviditet *	0,2%
Avkastning från årets början	21,97%
Avkastning Index	21,02%
Nav-kurs	405,20

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft	9,9
Alphabet	9,0
Nvidia	3,3
Visa	2,9
Tesla	2,6

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Procter & Gamble	2,5
Walt Disney	2,2
Mastercard	2,1
Eli Lilly & Company	2,0
Salesforce	1,9
Totalt	38,5

Referensindex: MSCI ESG Leaders USA NR (omräkn.sek)

AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

Perioden 160630-210630 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK)	3 605,7
Avkastning - portfölj	131,3%
Avkastning - index	123,7%
Skillnad	7,6%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	14,4%
Volatilitet - index	14,7%
Aktiv risk	1,5%
Info. Kvot	0,52
Sharpekvot - portfölj	1,31
Jensens alfa	1,3%
Beta	0,97
Förklaringsgrad	99,0%
Konsistens	51,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	3 605,7	2 761,4	2 826,5	1 808,6	1 528,3	1 751,1	1 267,5

Avkastning - portfölj	22,0%	6,2%	39,0%	5,3%	6,9%	18,7%	10,1%
Avkastning - index	21,0%	3,7%	38,2%	4,3%	8,0%	19,6%	8,1%
Skillnad	0,9%	2,5%	0,7%	1,0%	-1,1%	-0,9%	2,0%

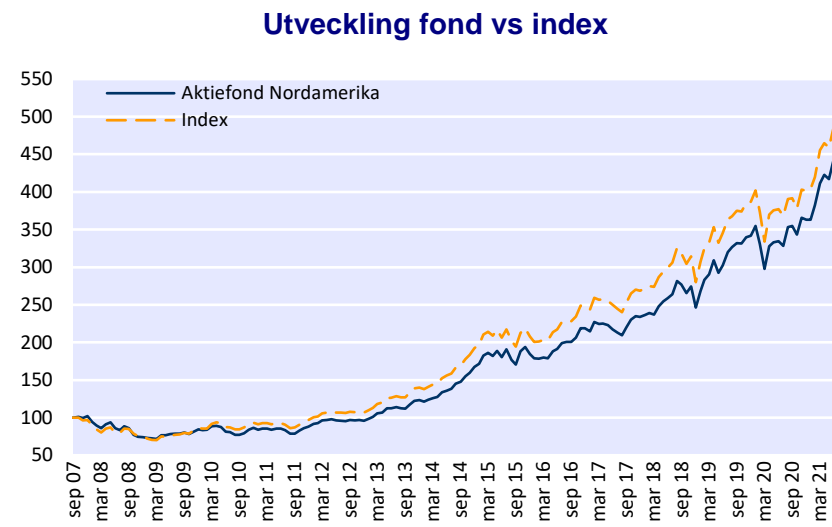
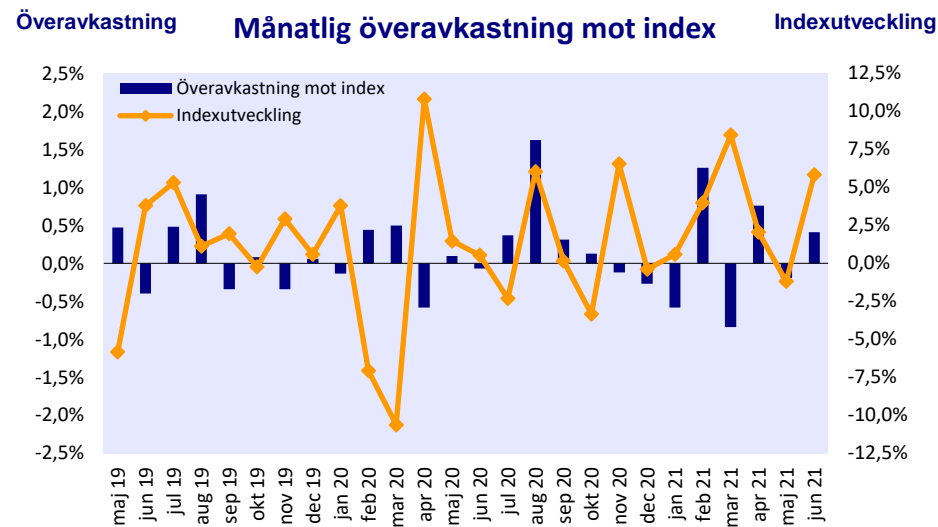
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	6,2%	7,7%	22,0%	32,4%	71,3%	131,3%	11,4%
Avkastning - index	5,8%	6,7%	21,0%	28,8%	62,3%	123,7%	12,2%
Skillnad	0,4%	1,0%	0,9%	3,6%	9,0%	7,6%	-0,8%

Referensindex: MSCI ESG Leaders USA NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

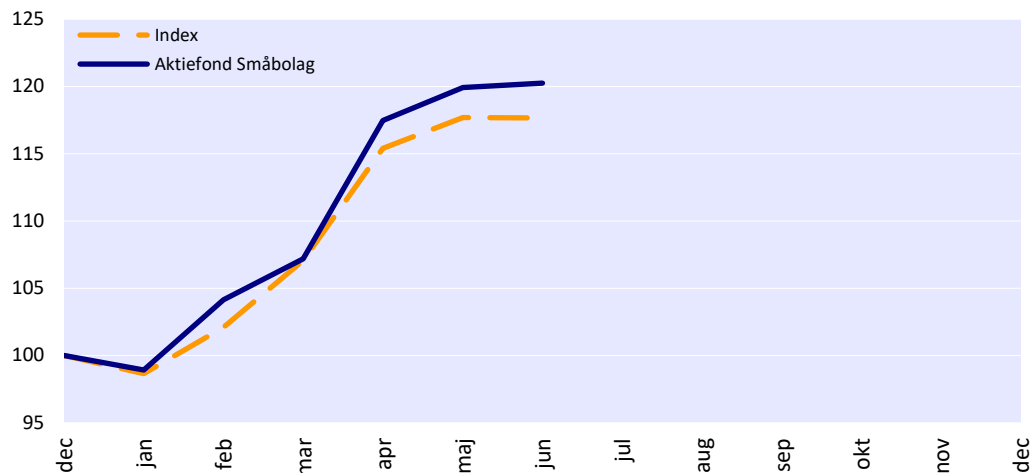
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



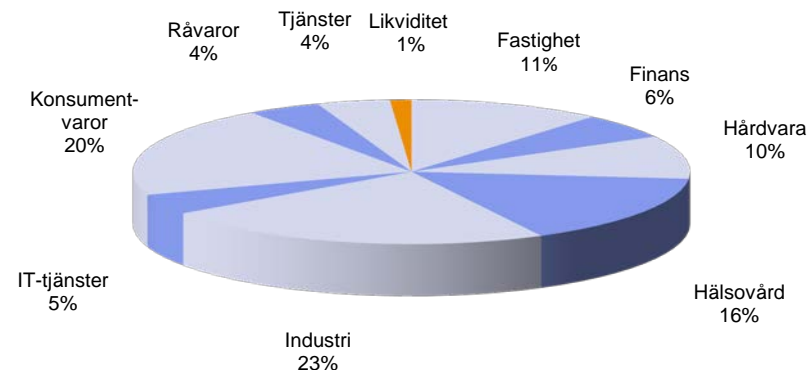
AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

Fonden placerar merparten av kapitalet i svenska aktier, men kan även placera upp till 25 procent på övriga nordiska börser. Fonden investerar i mindre och medelstora företag. Den är inte branschriktad, utan strävar efter att balansera placeringarna mellan olika typer av företag för att få god riskspridning.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Aktiefond Småbolag
Branschfördelning, %



Aktiefond Småbolag	
Totalt antal andelar	15 113 806
Total förmögenhet MSEK	21 243,1
Likviditet *	1,2%
Avkastning från årets början	20,25%
Avkastning index	17,65%
Nav-kurs	1405,54

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Sinch	3,1
AddLife	2,8
Nibe	2,7
Beijer Ref	2,7
SwedenCare	2,6

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Avanza	2,6
Medicover	2,6
Sweco	2,5
Sagax	2,5
Mips	2,5
Totalt	26,6

AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

Perioden 160630-210630 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	21 243,1
Avkastning - portfölj	198,1%
Avkastning - index	153,6%
Skillnad	44,4%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	16,9%
Volatilitet - index	17,3%
Aktiv risk	3,9%
Info. kvot	1,02
Sharpekvot - portfölj	1,48
Jensens alfa	4,6%
Beta	0,97
Förklaringsgrad	94,8%
Konsistens	61,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	21 243,1	16 069,7	9 803,5	6 723,3	7 358,6	6 492,9	5 666,5
Avkastning - portfölj	20,3%	41,5%	42,2%	-2,6%	9,6%	13,0%	34,2%
Avkastning - index	17,7%	23,0%	43,2%	-0,2%	8,8%	12,2%	30,1%
Skillnad	2,6%	18,5%	-1,0%	-2,4%	0,8%	0,9%	4,2%

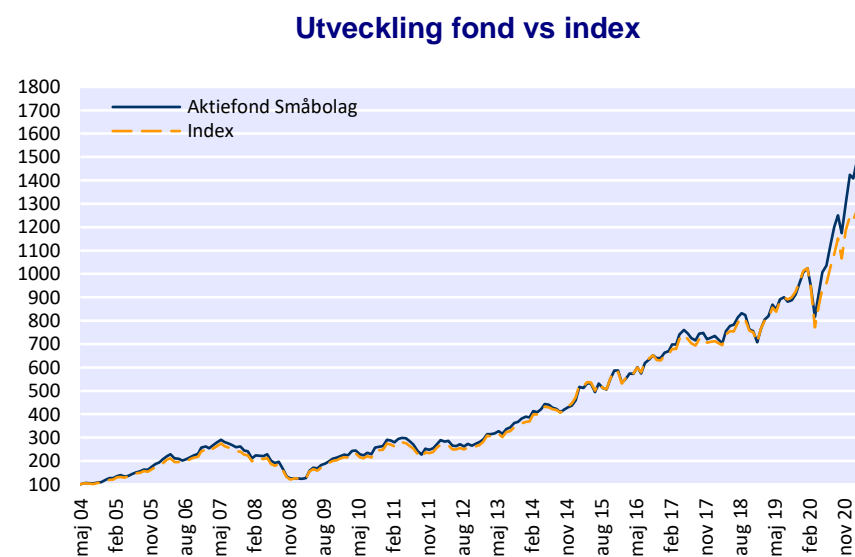
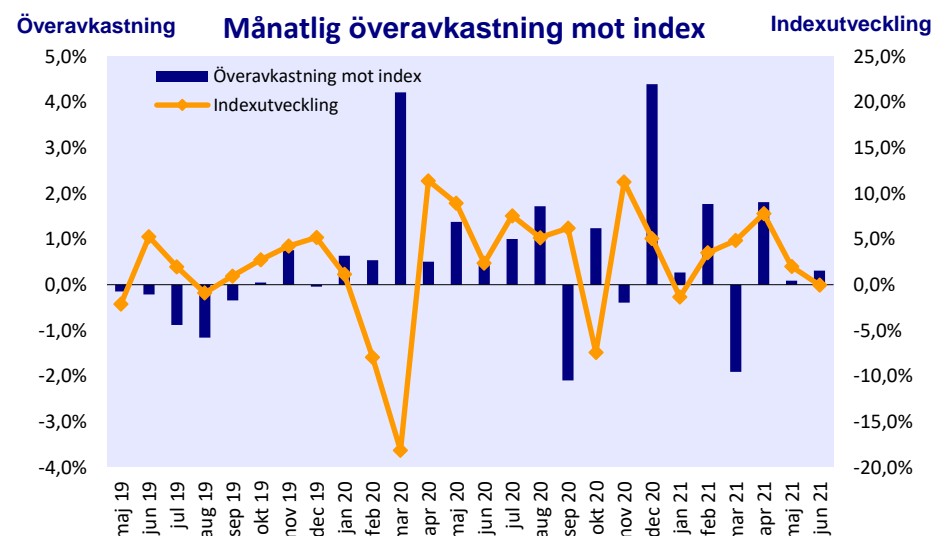
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,3%	12,2%	20,3%	65,3%	118,7%	198,1%	18,0%
Avkastning - index	0,0%	9,9%	17,7%	52,9%	94,3%	153,6%	17,0%
Skillnad	0,3%	2,3%	2,6%	12,4%	24,3%	44,4%	1,1%

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

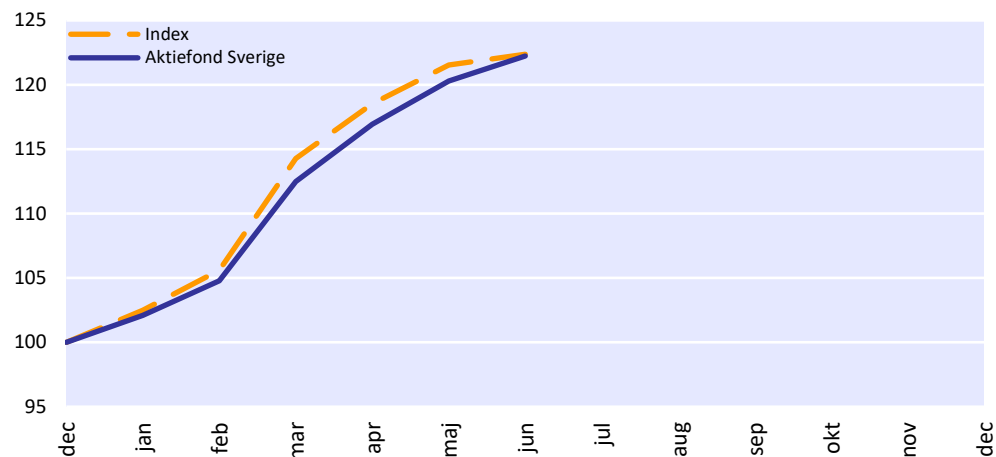
***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



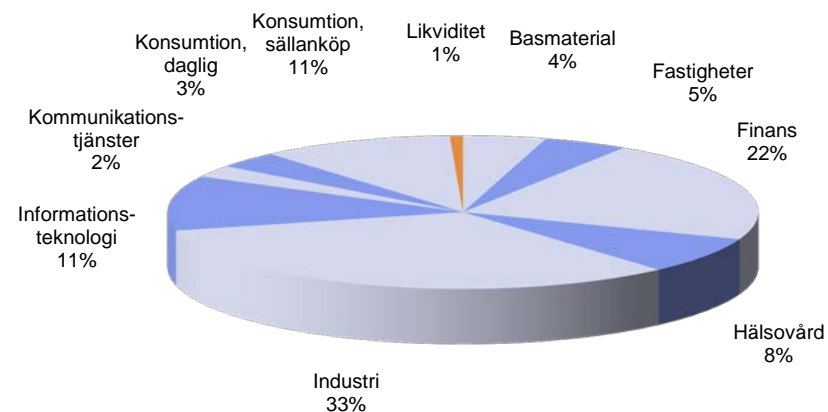
AMF AKTIEFOND SVERIGE

Fonden placerar enbart i aktier och aktierelaterade instrument som är noterade i Sverige.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Aktiefond Sverige
Branschfördelning, %



Aktiefond Sverige	
Totalt antal andelar	49 823 612
Total förmögenhet MSEK	44 747,4
Likviditet *	0,7%
Avkastning från årets början	22,23%
Avkastning Index	22,37%
Nav-kurs	898,12

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: SIXPRX

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	9,9
Atlas Copco	6,8
SEB	5,5
Hexagon	4,3
Volvo	4,3

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Ericsson	3,9
AstraZeneca	3,8
Epiroc	3,7
Indutrade	3,6
Essity	3,5
Totalt	49,3

AMF AKTIEFOND SVERIGE

Perioden 160630-210630 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	44 747,4
Avkastning - portfölj	101,2%
Avkastning - index	126,9%
Skillnad	-25,7%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	3
Volatilitet - portfölj	15,0%
Volatilitet - index	14,8%
Aktiv risk	1,8%
Info. kvot	-1,57
Sharpekvot - portfölj	1,04
Jensens alfa	-2,7%
Beta	1,00
Förklaringsgrad	98,6%
Konsistens	33,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	44 747,4	37 056,3	33 846,3	25 371,6	27 691,6	27 500,3	26 529,6
Avkastning - portfölj	22,2%	11,7%	25,7%	-4,9%	7,9%	8,6%	8,6%
Avkastning - index	22,4%	14,8%	35,0%	-4,6%	10,0%	9,2%	6,3%
Skillnad	-0,1%	-3,1%	-9,3%	-0,2%	-2,2%	-0,5%	2,4%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	1,6%	8,7%	22,2%	45,3%	57,2%	101,2%	12,3%
Avkastning - index	0,7%	7,1%	22,4%	46,6%	73,3%	126,9%	10,7%
Skillnad	0,9%	1,6%	-0,1%	-1,2%	-16,1%	-25,7%	1,7%

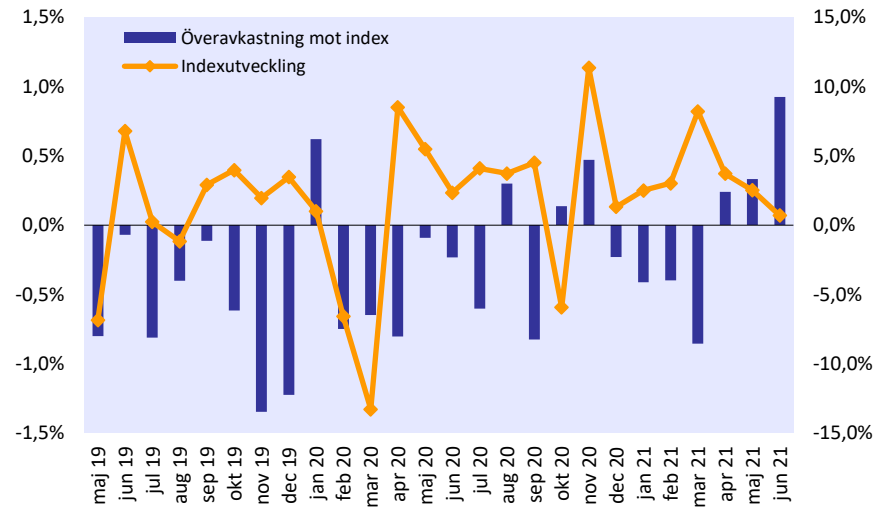
Referensindex: SIXPRX

* Alla värden beräknas inkl avgifter

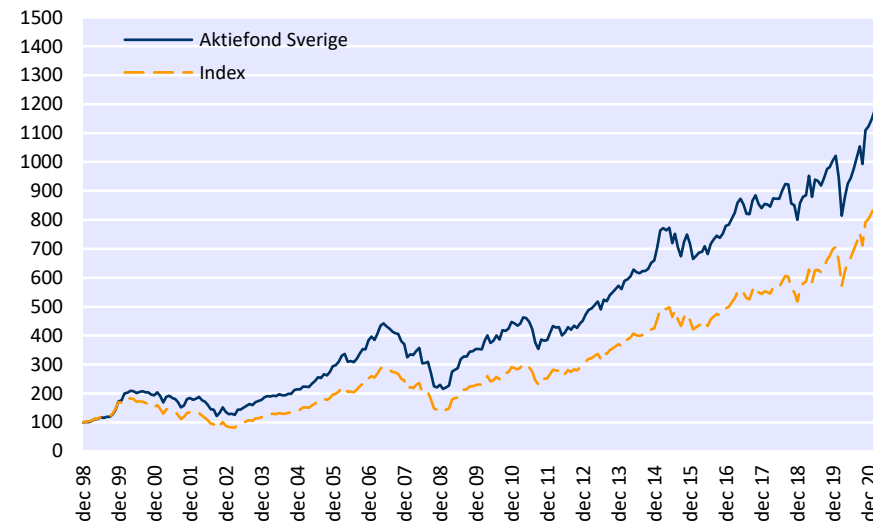
** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



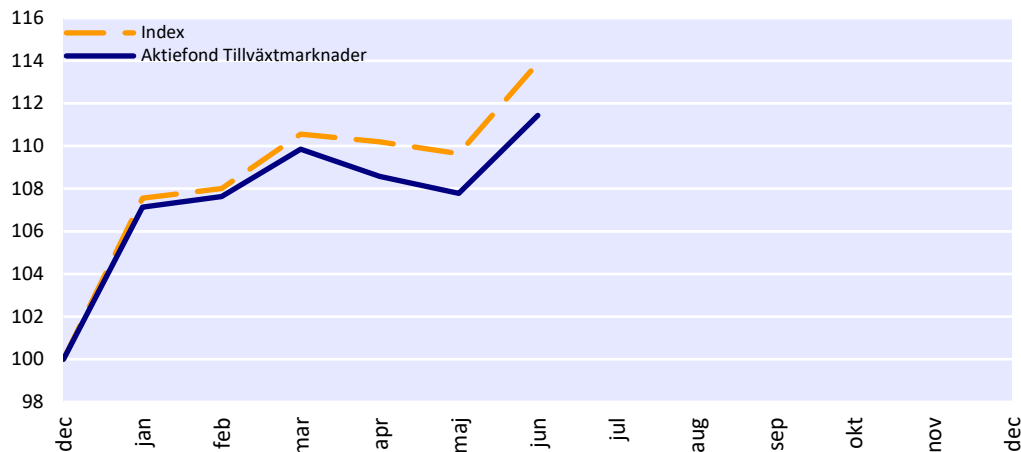
Utveckling fond vs index



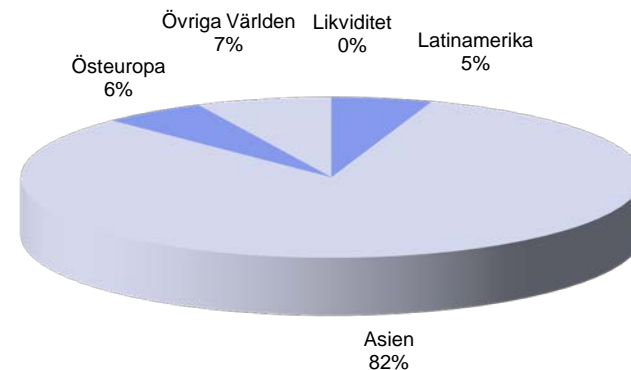
AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

Fonden är en aktiefond med inriktning mot så kallade tillväxtmarknader. Länder som klassificeras som tillväxtmarknader återfinns i Asien, Afrika, Latinamerika och Östeuropa.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



**Placeringar i Aktiefond
Tillväxtmarknader**
Regionfördelning, %



Aktiefond Tillväxtmarknader	
Totalt antal andelar	17 774
Total förmögenhet MSEK	2 230,4
Likviditet *	0,0%
Avkastning från årets början	11,44%
Avkastning Index	13,89%
Nav-kurs	125,49

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	9,8
Alibaba Group Holding, Kina	9,7
Tencent Holdings, Kina	8,7
Meituan Dianping, Kina	3,0
Reliance Industries, Indien	2,6

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Naspers, Sydafrika	2,3
Mediatek, Taiwan	2,2
Infosys, Indien	2,0
Chailease Holding, Taiwan	1,8
China Construction Bank, Kina	1,7
Totalt	43,8

Referensindex: MSCI Emerging Markets ESG Leaders NR (omräkn.sek)

AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

Perioden 191211-210630 ^{1),2)}	
Marknadsvärde (MSEK)	2 230,4
Avkastning - portfölj	25,5%
Avkastning - index	25,3%
Skillnad	0,1%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating	-
Volatilitet - portfölj ³⁾	14,4%
Volatilitet - index ³⁾	14,1%
Aktiv risk ²⁾	-
Info. Kvot ²⁾	-
Sharpekvot - portfölj ²⁾	-
Jensens alfa ²⁾	-
Beta ²⁾	-
Förklaringsgrad ²⁾	-
Konsistens ²⁾	42,1%

	2021	2020	2019
Marknadsvärde (MSEK)	2 230,4	1 653,4	322,2
Avkastning - portfölj	11,4%	7,9%	4,4%
Avkastning - index	13,9%	5,4%	4,5%
Skillnad	-2,5%	2,5%	-0,1%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	Start ⁴⁾
Avkastning - portfölj	3,4%	1,4%	11,4%	30,3%	15,9%
Avkastning - index	3,9%	3,0%	13,9%	30,0%	15,8%
Skillnad	-0,5%	-1,6%	-2,5%	0,3%	0,1%

Referensindex: MSCI Emerging Markets ESG Leaders NR (omräkn.sek)

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

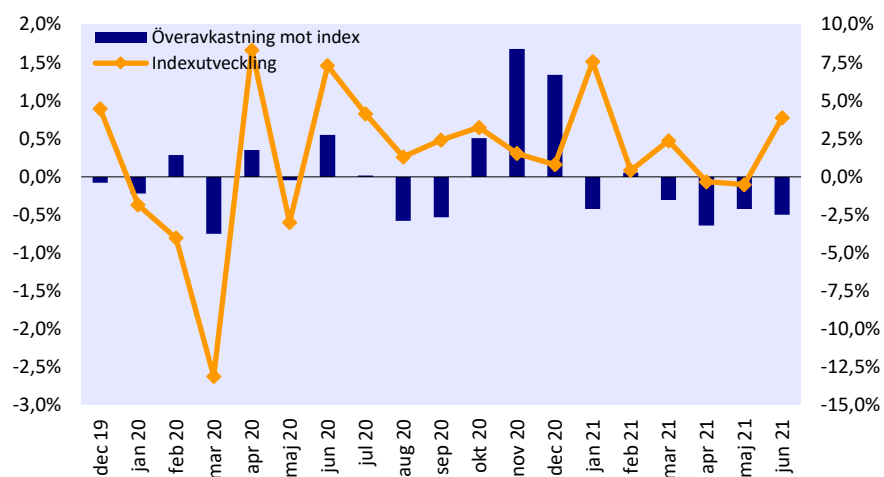
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

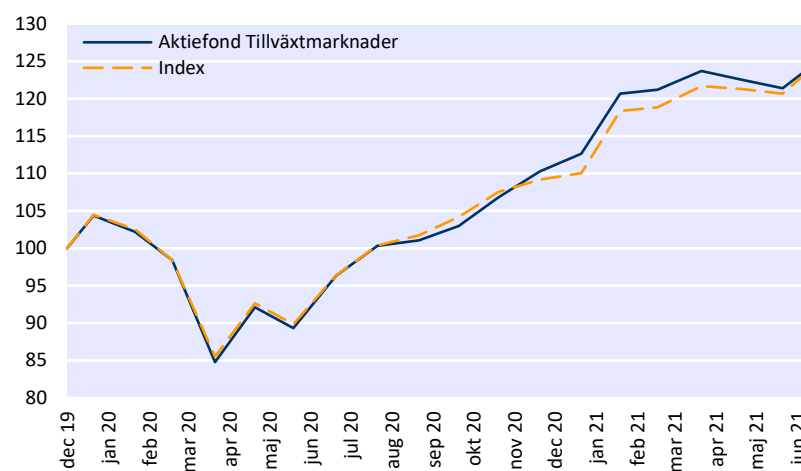
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



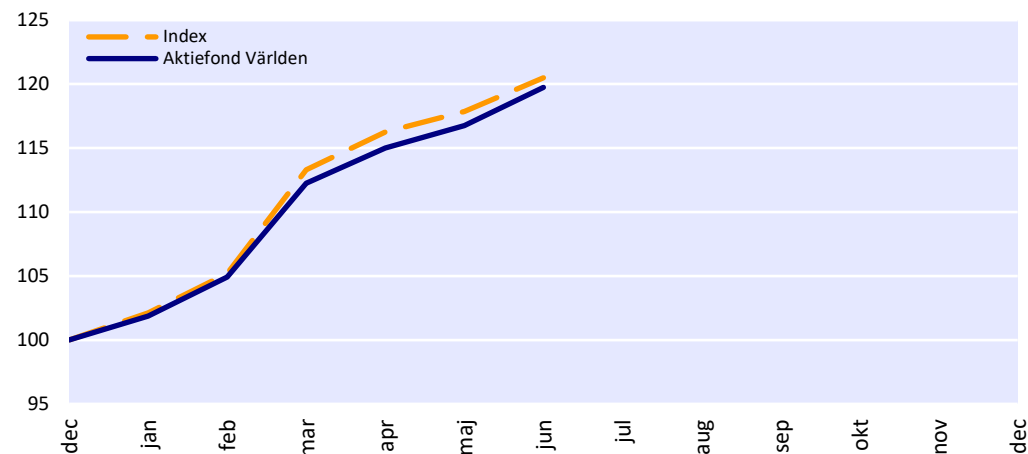
Utveckling fond vs index



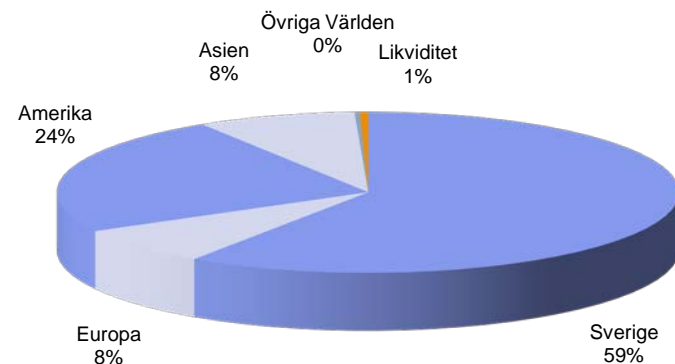
AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

Fonden placerar i svenska och utländska marknadsnoterade aktier. De utländska aktierna får som mest stå för 60% av fondvärdet och är koncentrerade till USA och Västeuropa.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Aktiefond Världen
Regionfördelning, %



Aktiefond Världen

Totalt antal andelar	83 510 008
Total förmögenhet MSEK	48 378,3
Likviditet *	0,4%
Avkastning från årets början	19,74%
Avkastning Index	20,49%
Nav-kurs	579,31

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	5,7
Atlas Copco	3,7
SEB	3,1
Microsoft, USA	3,1
AstraZeneca	2,6

Största aktieinnehav

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Hexagon	2,4
Alphabet, USA	2,4
Volvo	2,3
Epiroc	2,2
Indutrade	2,1
Totalt	29,5

Referensindex: SIXRX 60%, MSCI ACWI ESG Leaders NR (omräkn.sek) 40%

AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

Perioden 160630-210630 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 48 378,3

Avkastning - portfölj 97,8%

Avkastning - index 116,6%

Skillnad -18,7%

Riskindikator 6

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating ** 3

Volatilitet - portfölj 13,6%

Volatilitet - index 13,7%

Aktiv risk 1,4%

Info. kvot -1,49

Sharpekvot - portfölj 1,12

Jensens alfa -1,8%

Beta 0,98

Förklaringsgrad 98,9%

Konsistens 36,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	48 378,3	41 075,8	39 160,8	31 486,5	33 731,8	32 024,0	29 410,8

Avkastning - portfölj 19,7% 8,0% 28,3% -3,7% 8,1% 11,6% 8,7%

Avkastning - index 20,5% 9,6% 34,8% -3,2% 10,5% 12,0% 6,0%

Skillnad -0,8% -1,5% -6,5% -0,5% -2,4% -0,4% 2,7%

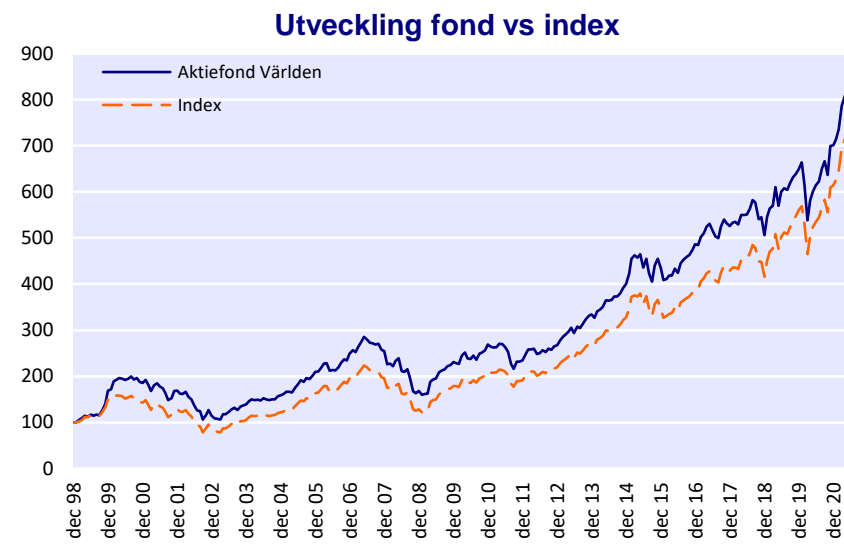
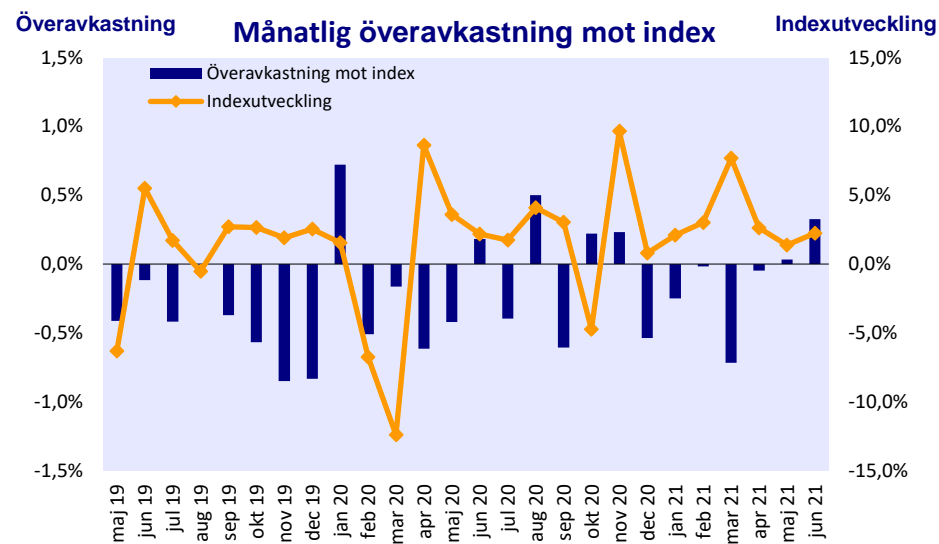
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	2,6%	6,7%	19,7%	36,7%	52,4%	97,8%	9,9%
Avkastning - index	2,2%	6,4%	20,5%	38,4%	62,7%	116,6%	9,3%
Skillnad	0,3%	0,3%	-0,8%	-1,7%	-10,4%	-18,7%	0,6%

Referensindex: SIXRX 60%, MSCI ACWI ESG Leaders NR (omräkn.sek) 40%

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

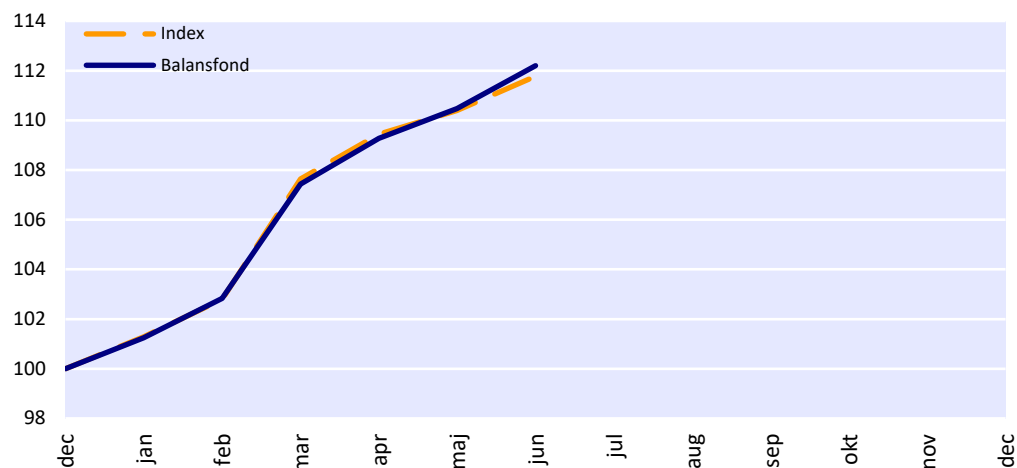
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



AMF BALANSFOND

Fonden placerar i svenska och utländska aktier samt i svenska obligationer. För att vara mindre känslig för börsens svängningar ska minst 25 procent av fondvärdet vara placerat i svenska obligationer.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Balansfond
fördelning aktier/räntebärande, %



Balansfond	
Totalt antal andelar	72 495 086
Total förmögenhet MSEK	26 651,3
Likviditet *	0,5%
Modifierad duration	3,96%
Avkastning från årets början	12,20%
Avkastning Index	11,77%
Nav-kurs	367,63

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	4,2
Atlas Copco	2,8
SEB	2,3
AstraZeneca	1,8
Hexagon	1,8
Totalt	12,9

Största ränteb. Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	7,3
SEB Bolån	3,7
SBAB	3,0
LF Hypotek	2,1
Castellum	2,1
Totalt	18,2

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds 40%, SIXRX 40%, MSCI ACWI ESG Leaders NR (omräkn Sek) 20%

AMF BALANSFOND

Perioden 160630-210630 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	26 651,3
Avkastning - portfölj	55,6%
Avkastning - index	63,5%
Skillnad	-7,9%

Riskindikator	4
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	8,7%
Volatilitet - index	8,3%
Aktiv risk	1,0%
Info. kvot	-1,07
Sharpekvot - portfölj	1,13
Jensens alfa	-1,4%
Beta	1,03
Förklaringsgrad	98,7%
Konsistens	36,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	26 651,3	23 820,1	23 265,8	20 513,5	21 734,7	21 288,0	20 303,8
Avkastning - portfölj	12,2%	6,0%	16,9%	-1,9%	5,2%	8,3%	5,6%
Avkastning - index	11,8%	7,3%	20,5%	-1,5%	6,4%	8,1%	4,1%
Skillnad	0,4%	-1,3%	-3,7%	-0,5%	-1,2%	0,1%	1,4%

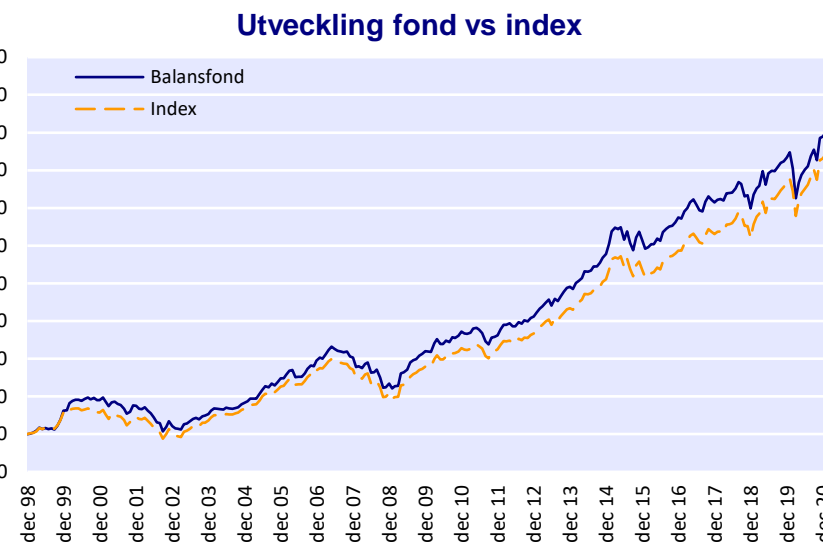
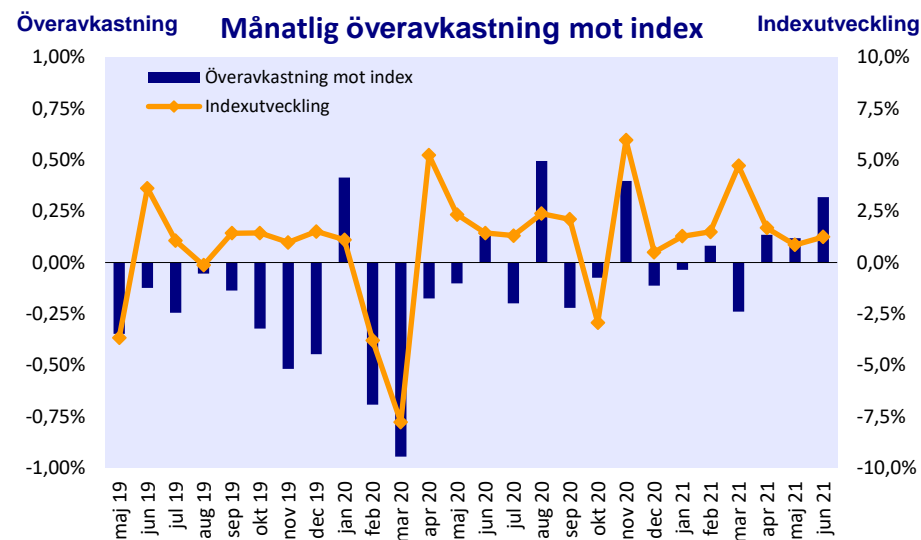
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	1,6%	4,4%	12,2%	23,1%	32,0%	55,6%	7,9%
Avkastning - index	1,2%	3,8%	11,8%	22,4%	37,1%	63,5%	7,6%
Skillnad	0,3%	0,6%	0,4%	0,8%	-5,2%	-7,9%	0,3%

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds 40%, SIXRX 40%, MSCI ACWI ESG Leaders NR (omräkn Sek) 20

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

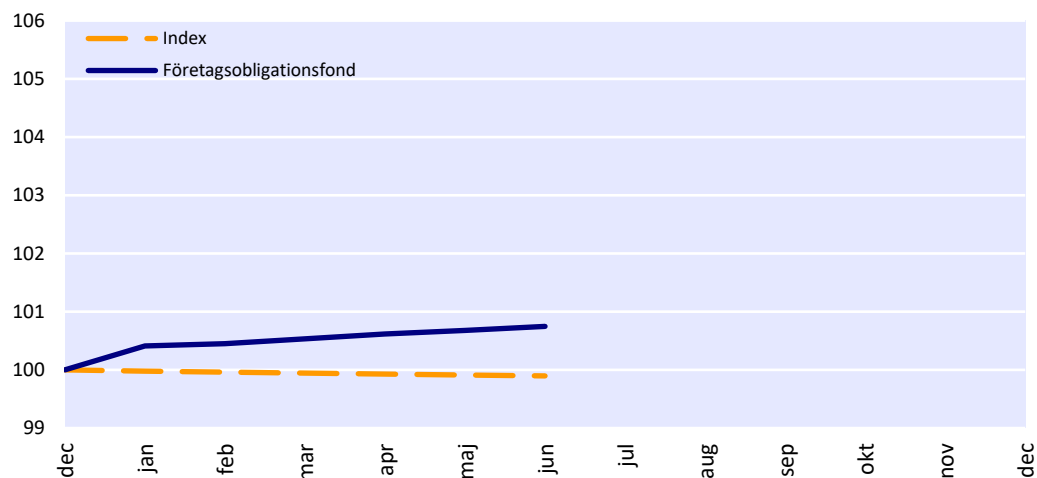
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



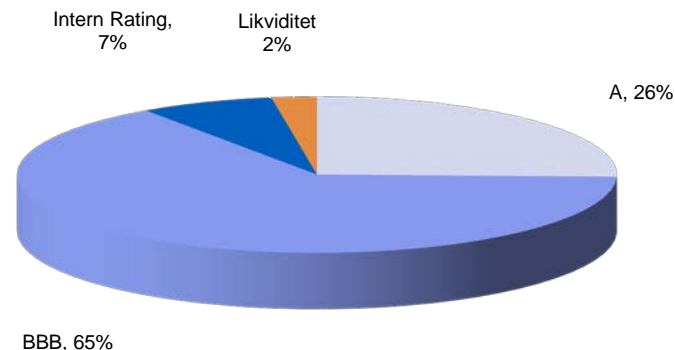
AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

Fonden investerar i svenska räntebärande värdepapper vars sammanvägda genomsnittliga räntebindningstid är kortare än ett år. Fondens medel ska placeras i räntebärande värdepapper och penningmarknadsinstrument huvudsakligen utgivna av företag med hög kreditvärdighet samt på konto i kreditinstitut.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Företagsobligationsfond
Rating, %



Företagsobligationsfond	
Totalt antal andelar	8 130 477
Total förmögenhet MSEK	833,3
Likviditet *	2,4%
Duration	0,86
Modifierad duration	0,86%
Modifierad duration krediter	0,86%
Yield	0,67%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	3,24
Avkastning från årets början	0,75%
Avkastning index	-0,10%
Nav-kurs	102,49

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Castellum	6,7
SBAB Bank	6,4
Willhem	6,3
Santander Consumer Bank	4,9
LF Bank	4,4
	28,7

AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

Perioden 180829-210630 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK) 833,3

Avkastning - portfölj 2,49%

Avkastning - index -1,10%

Skillnad 3,59%

Riskindikator ³⁾ 1

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating -

Volatilitet - portfölj ³⁾ 1,7%

Volatilitet - index ³⁾ 0,1%

Aktiv risk ²⁾ 2,3%

Info. Kvot ²⁾ 0,56

Sharpekvot - portfölj ²⁾ 0,84

Jensens alfa ²⁾ 0,8%

Beta ²⁾ 4,26

Förklaringsgrad ²⁾ 2,1%

Konsistens ²⁾ 77,1%

	2021	2020	2019	2018
Marknadsvärde (MSEK)	833,3	700,1	641,8	536,5

Avkastning - portfölj 0,75% 0,99% 1,60% -0,86%

Avkastning - index -0,10% -0,17% -0,53% -0,30%

Skillnad 0,85% 1,17% 2,13% -0,56%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	Start ⁴⁾
Avkastning - portfölj	0,07%	0,22%	0,75%	2,77%	0,87%
Avkastning - index	-0,02%	-0,05%	-0,10%	-0,16%	-0,39%
<i>Skillnad</i>	0,08%	0,26%	0,85%	2,93%	1,26%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

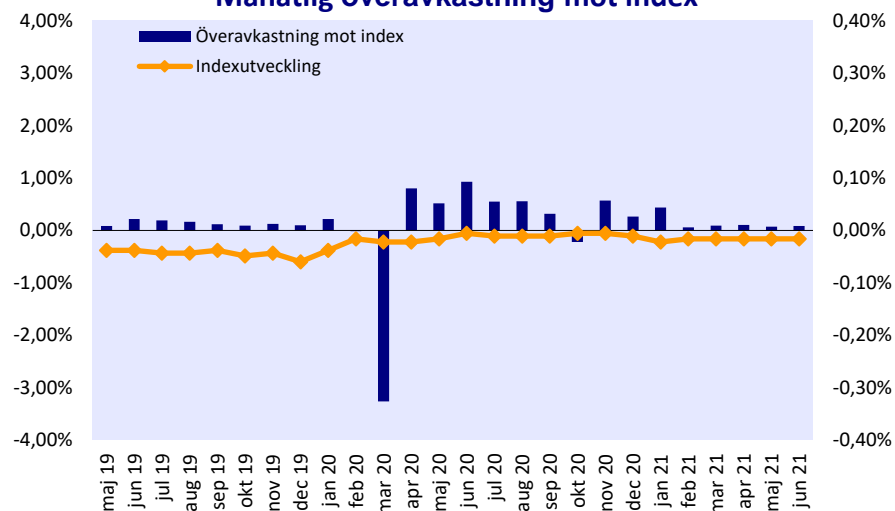
¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

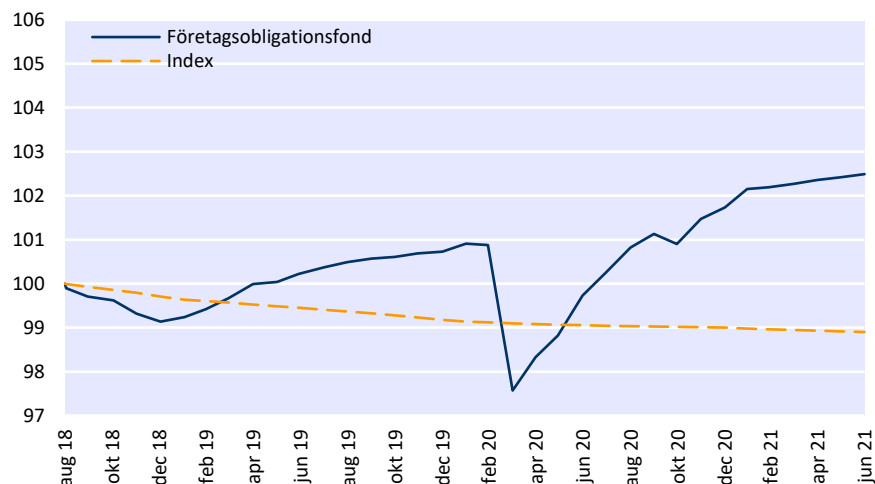
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



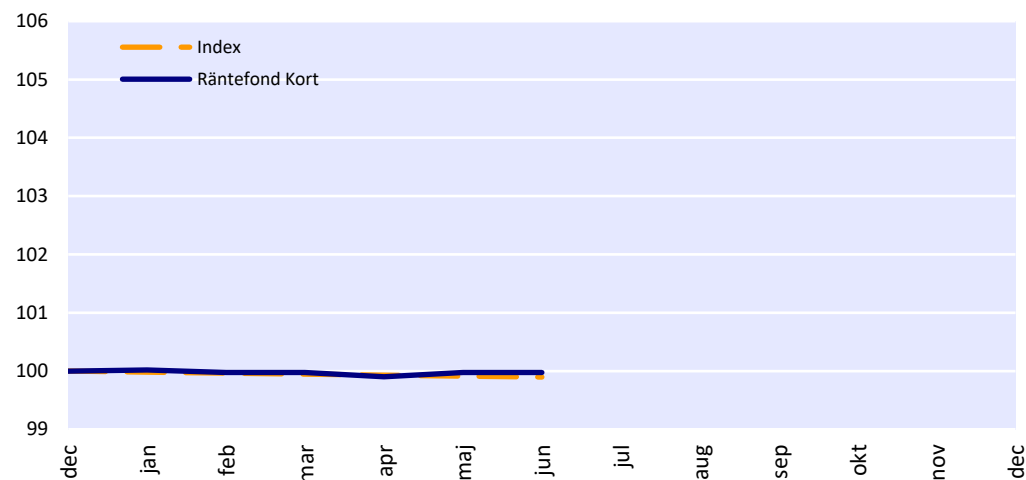
Utveckling fond vs index



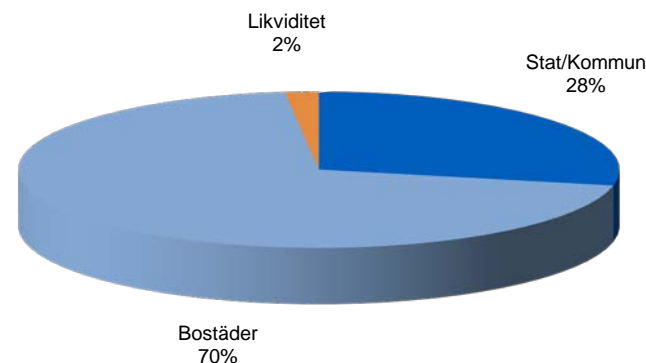
AMF RÄNTEFOND KORT

Fonden investerar i svenska räntebärande värdepapper vars sammanvägda genomsnittliga räntebindningstid är kortare än ett år. Strategin är att hålla en låg risk och ge en stabil avkastning. Investeringarna sker i statskuldväxlar samt i instrument utgivna av banker, bostadsfinansieringsinstitut och andra kreditvärldiga företag och organisationer.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Räntefond Kort
Emittentfördelning, %



Räntefond Kort

Totalt antal andelar	47 916 169
Total förmögenhet MSEK	5 343,3
Likviditet *	1,8%
Duration	0,58
Modifierad duration	0,58%
Modifierad duration krediter	0,58%
Yield	-0,01%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	2,22
Avkastning från årets början	-0,03%
Avkastning index	-0,10%
Nav-kurs	111,51

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Kommuninvest	18,9
Nykredit	16,7
Skandiabanken	16,7
Landshypotek	10,9
African Development Bank	7,3
Totalt	70,4

AMF RÄNTEFOND KORT

Perioden 160630-210630 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 5 343,3

Avkastning - portfölj -0,91%
 Avkastning - index -2,74%
 Skillnad 1,83%

Riskindikator 1
 Hållbarhetsbetyg -
 Morningstar rating ** -
 Volatilitet - portfölj 0,2%
 Volatilitet - index 0,1%
 Aktiv risk 0,2%
 Info. kvot 2,30
 Sharpekvot - portfölj 2,10
 Jensens alfa 0,4%
 Beta 0,89
 Förklaringsgrad 16,6%
 Konsistens 90,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	5 343,3	5 582,1	4 443,6	5 252,2	4 834,0	5 384,6	6 380,6

Avkastning - portfölj	-0,03%	0,27%	-0,30%	-0,46%	-0,34%	0,07%	-0,37%
Avkastning - index	-0,10%	-0,17%	-0,53%	-0,81%	-0,77%	-0,66%	-0,27%
Skillnad	0,08%	0,44%	0,23%	0,34%	0,43%	0,73%	-0,10%

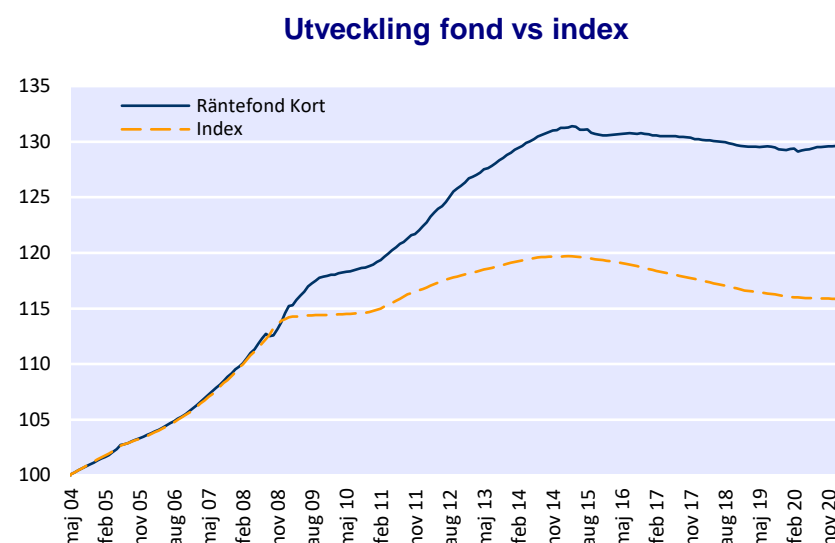
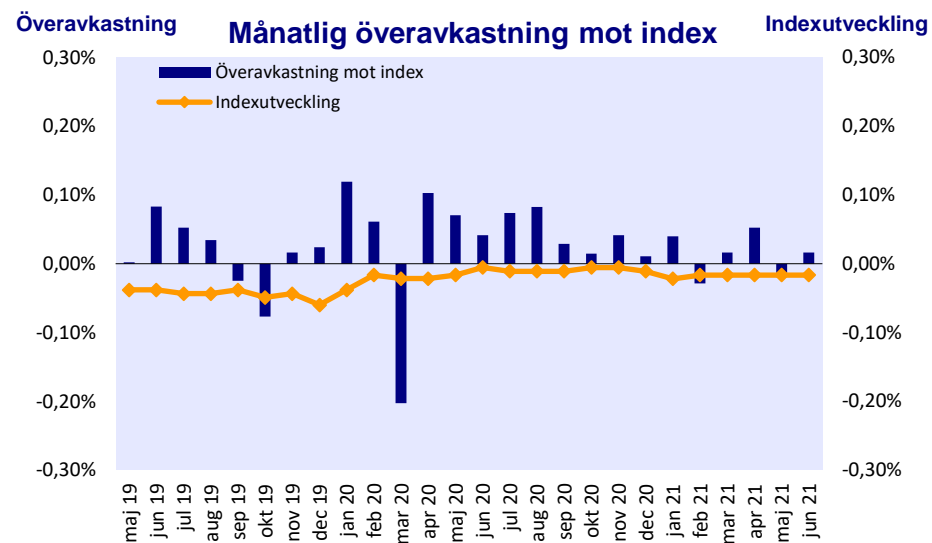
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,00%	0,00%	-0,03%	0,17%	-0,38%	-0,91%	1,52%
Avkastning - index	-0,02%	-0,05%	-0,10%	-0,16%	-1,23%	-2,74%	0,86%
Skillnad	0,02%	0,05%	0,08%	0,33%	0,85%	1,83%	0,66%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

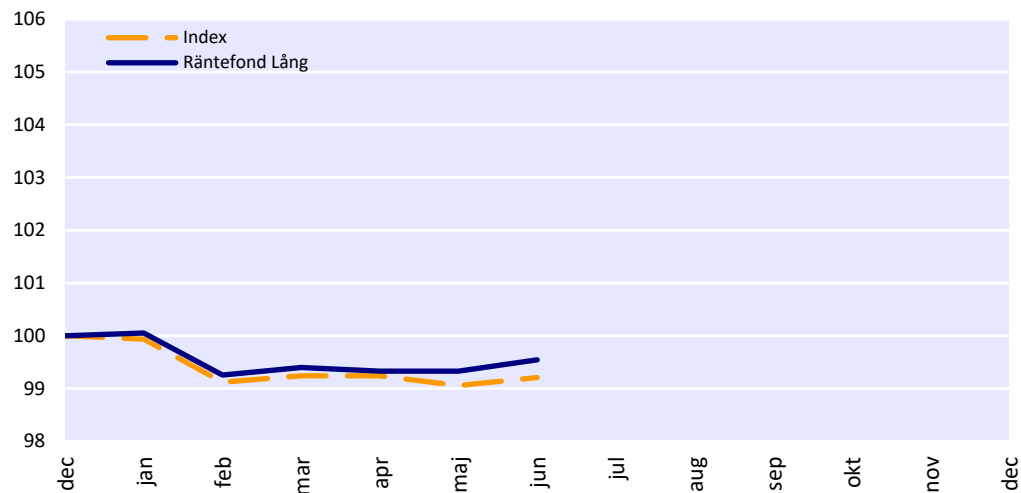
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



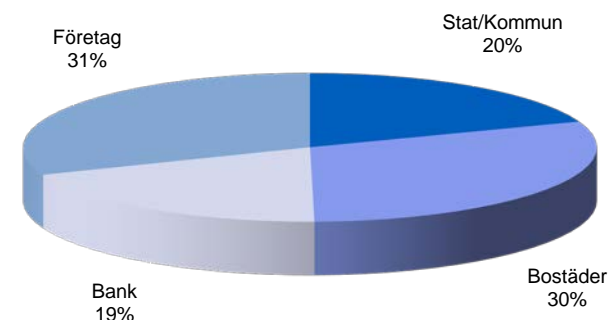
AMF RÄNTEFOND LÅNG

Fonden placerar enbart i svenska räntebärande värdepapper, såsom statsobligationer och instrument utgivna av bostadsfinansieringsinstitut och andra kreditvärdiga företag och organisationer.

Utveckling 2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Råntefond Lång Emittentfördelning, %



Råntefond Lång	
Totalt antal andelar	55 958 361
Total förmögenhet MSEK	8 464,6
Likviditet *	-10,7%
Duration	4,26
Modifierad duration	4,24%
Modifierad duration krediter	2,48%
Yield	0,44%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	4,34
Avkastning från årets början	-0,45%
Avkastning Index	-0,79%
Nav-kurs	151,27

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Stat Sverige	21,5
SEB Bolån	10,6
SBAB	8,8
LF Hypotek	6,4
Volkswagen Finans	5,5
	52,7

AMF RÄNTEFOND LÅNG

Perioden 160630-210630 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	8 464,6
Avkastning - portfölj	4,9%
Avkastning - index	2,7%
Skillnad	2,1%

Riskindikator	2
Hållbarhetsbetyg	-
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	1,6%
Volatilitet - index	1,3%
Aktiv risk	0,7%
Info. kvot	0,62
Sharpekvot - portfölj	0,94
Jensens alfa	0,3%
Beta	1,10
Förklaringsgrad	83,5%
Konsistens	85,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	8 464,6	8 859,8	8 621,8	8 077,9	6 970,1	7 328,8	6 501,6
Avkastning - portfölj	-0,5%	2,0%	1,7%	1,2%	0,7%	3,3%	0,5%
Avkastning - index	-0,8%	1,4%	1,2%	1,0%	0,4%	2,8%	0,5%
Skillnad	0,3%	0,6%	0,5%	0,1%	0,3%	0,5%	0,0%

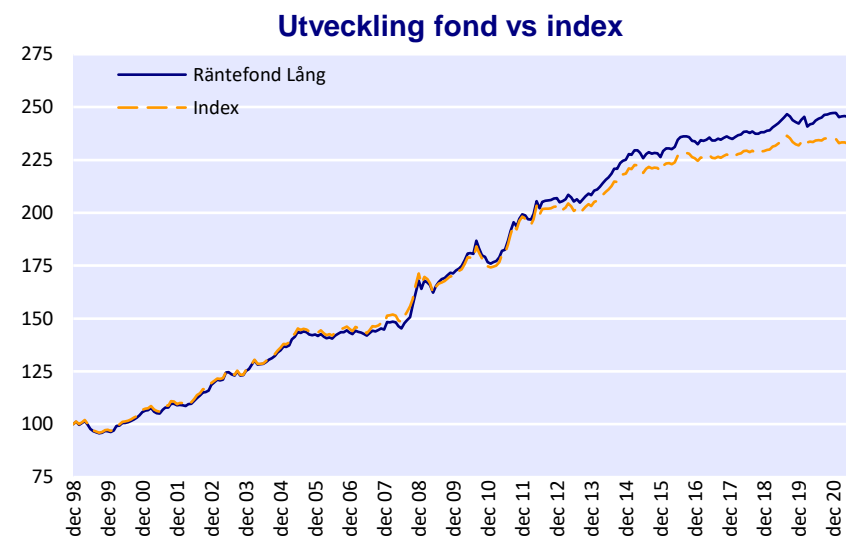
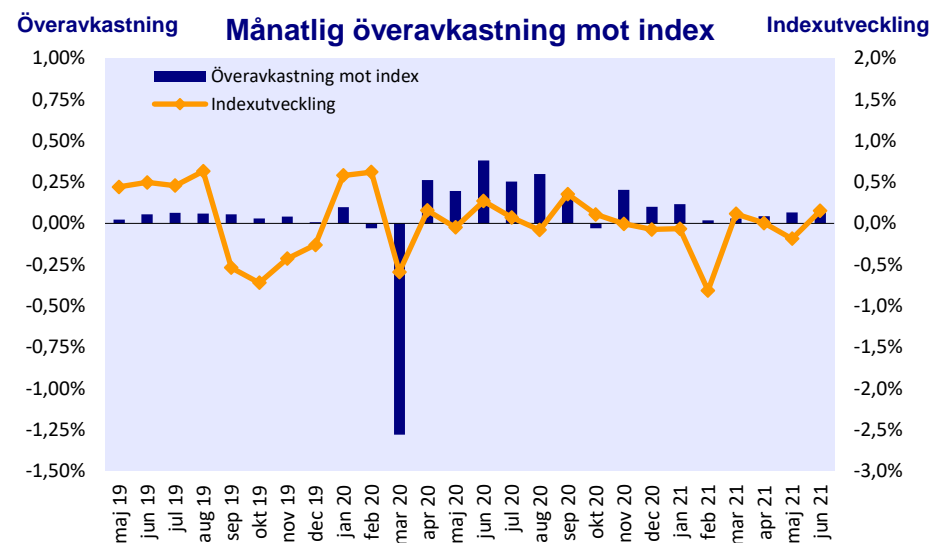
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,2%	0,1%	-0,5%	0,9%	3,2%	4,9%	4,1%
Avkastning - index	0,2%	0,0%	-0,8%	-0,4%	1,7%	2,7%	3,8%
Skillnad	0,1%	0,2%	0,3%	1,4%	1,5%	2,1%	0,2%

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

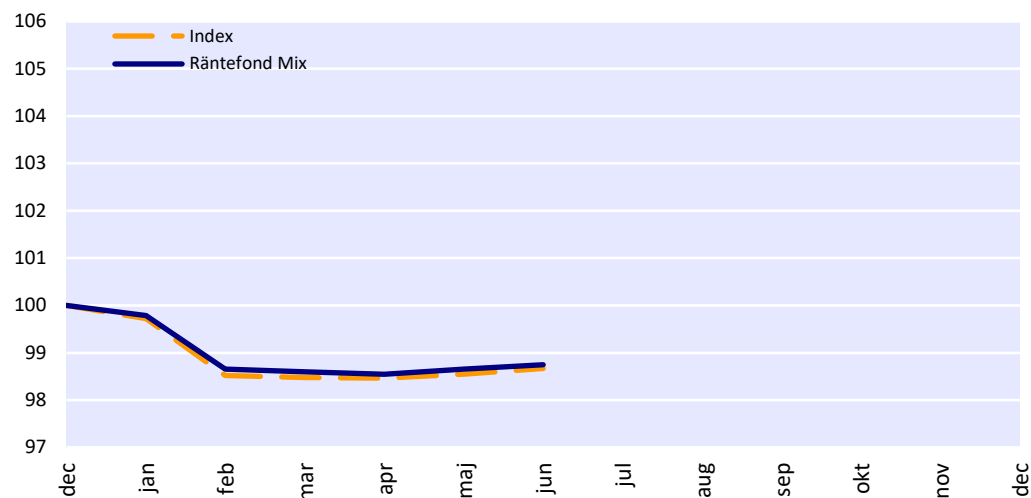
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



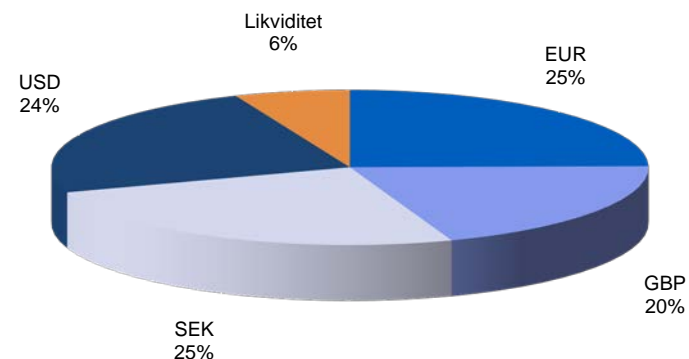
AMF RÄNTEFOND MIX

Fonden placerar i räntebärande värdepapper denominerade i amerikanska dollar, brittiska pund, svenska kronor eller euro. Fonden använder valutaderivat i syfte att helt valutasäkra fondens innehav till svenska kronor.

Utveckling
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Räntefond Mix
Emittentfördelning, %



Räntefond Mix

Totalt antal andelar	25 924 538
Total förmögenhet MSEK	3 099,3
Likviditet *	6,3%
Duration	4,52
Modifierad duration	4,52%
Modifierad duration krediter	1,87%
Yield	0,18%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	4,48
Avkastning från årets början	-1,26%
Avkastning Index	-1,33%
Nav-kurs	119,55

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Stat USA	23,1
Stat Storbritannien	18,9
Stat Tyskland	17,2
Stat Sverige	12,3
Stat Italien	6,9
Totalt	78,5

Referensindex: 25% Handelsb. Markets Sweden All Government Bonds 1-10 år, 25% JPM Germany Government index 1-10 år, 25% JPM UK Government index 1-10 år, 25% JPM US Treasury index 1-10 år hedgat till SEK

AMF RÄNTEFOND MIX

Perioden 160630-210630 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 3 099,3

Avkastning - portfölj 1,0%

Avkastning - index 0,2%

Skillnad 0,8%

Riskindikator 3

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating ** -

Volatilitet - portfölj 1,7%

Volatilitet - index 1,7%

Aktiv risk 0,3%

Info. Kvot 0,59

Sharpekvot - portfölj 0,45

Jensens alfa 0,2%

Beta 0,97

Förklaringsgrad 97,2%

Konsistens 66,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	3 099,3	3 375,6	1 790,2	1 285,9	990,9	905,7	764,1

Avkastning - portfölj -1,3% 2,7% 1,7% 0,0% -0,6% 2,1% 0,6%

Avkastning - index -1,3% 2,4% 1,4% 0,0% -0,7% 1,9% 0,5%

Skillnad 0,1% 0,3% 0,2% 0,0% 0,2% 0,2% 0,1%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,1%	0,2%	-1,3%	-0,9%	3,3%	1,0%	1,9%
Avkastning - index	0,1%	0,2%	-1,3%	-1,4%	2,7%	0,2%	1,6%
<i>Skillnad</i>	0,0%	0,0%	0,1%	0,5%	0,6%	0,8%	0,3%

Referensindex: 25% Handelsb. Markets Sweden All Government Bonds 1-10 år, 25% JPM Germany Government index 1-10 år, 25% JPM UK Government index 1-10 år, 25% JPM US Treasury index 1-10 år hedgat till SEK

* Alla värden beräknas inkl avgifter

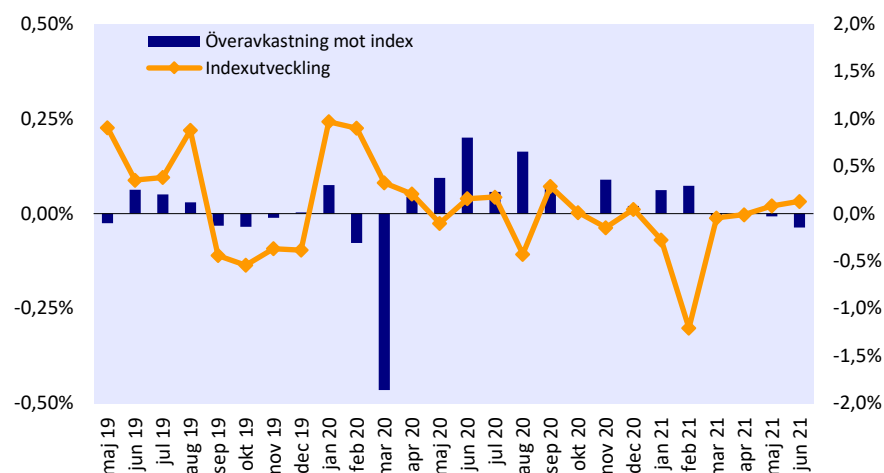
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

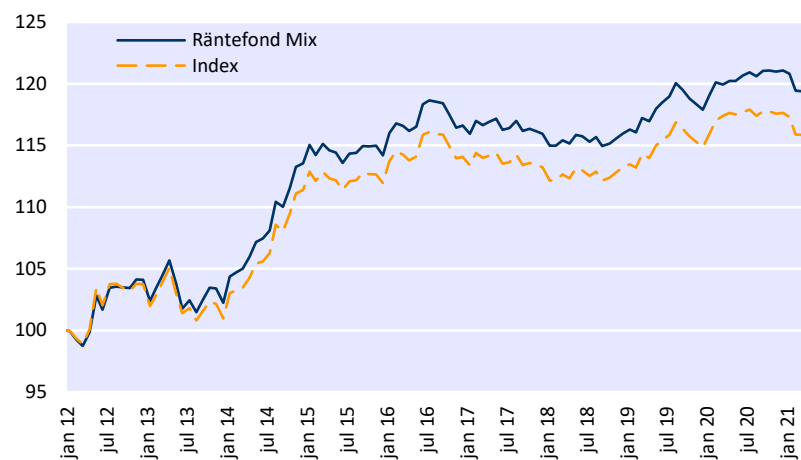
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



Utveckling fond vs index



DEFINITIONER

Avkastning	Avkastningen avser den värdeökning alternativt värdeminskning som uppstår från periodens början till dess slut, inklusive direktavkastning.
Duration	Duration är en räntefonds genomsnittliga återbetalningstid, vägd med kassaströmmarnas nuvärde.
Modifierad Duration	Modifierad duration anger hur känsligt räntefondens värde är för förändringar i räntenivån, det vill säga med hur många procent fondens värde ändras när räntenivån sjunker eller stiger med en procentenhet.
Yield	Förväntad avkastning vid oförändrad räntenivå.
Modifierad Duration Krediter	Modifierad duration på alla innehav exklusive sådana utgivna av stater.
Genomsnittlig löptid till förfall	En sammanvägning av alla innehavs löptid till slutligt förfall.
Volatilitet <i>(total risk)</i>	Volatilitet är ett riskmått, som avser spridning kring förväntad avkastning. Ett stort spridningsmått innebär hög risk och vice versa. Till exempel innebär 10% volatilitet att avkastningen med två tredjedels sannolikhet kommer att hamna inom +/- 10% från den förväntade avkastningen.
Aktiv risk <i>(Tracking Error)</i>	Den aktiva risken mäter storleken på avvikelsen mellan en fonds och dess jämförelseindex avkastning. En hög aktiv risk indikerar att förvaltningen avviker mycket från den övriga marknaden, index. Till exempel innebär 5% aktiv risk att fondens avkastning, två år av tre, kommer att hamna inom ett intervall om 5% från dess jämförelseindex avkastning.
Informationskvot	Informationskvoten ställer en fonds uppnådda avkastning (utöver jämförelseindex) i relation till den aktiva risken. Måttet anger hur mycket extra avkastning som uppnåtts jämfört med hur mycket extra risk som tagits.
Sharpekvot	Ställer avkastning i relation till den totala risken. Anger hur mycket avkastning, nedjusterad med den riskfria räntan, som uppnåtts i relation till hur mycket risk som tagits.
Jensens alfa	Beskriver den uppnådda över- eller underavkastning i förhållande till jämförelseindex med justering av beta, det vill säga med hänsyn till hur stor marknadsrisk som tagits. Om alfa är positivt har fonden överavkastat i förhållande till den marknadsrisk som tagits.
Beta	Beta anger sambandet mellan en fonds avkastning och dess marknads avkastning. Om $\beta = 1$ tenderar fondens avkastning att uppföra sig som marknads avkastning. $\beta < 1$ innebär att marknads svängningar försvagas och $\beta > 1$ betyder att marknads svängningar förstärks.
Förklaringsgrad	Förklaringsgraden anger hur starkt sambandet är mellan en fond och dess index.
Konsistens	Konsistensen anger hur stor andel av periodens totala antal månader som en fond överträffat jämförelseindex. Måttet kan anta värden mellan 0 och 100 procent, ju högre värde desto bättre konsistens.