

AMF Fonder AB - Månadsrapport

per 2021-11-30

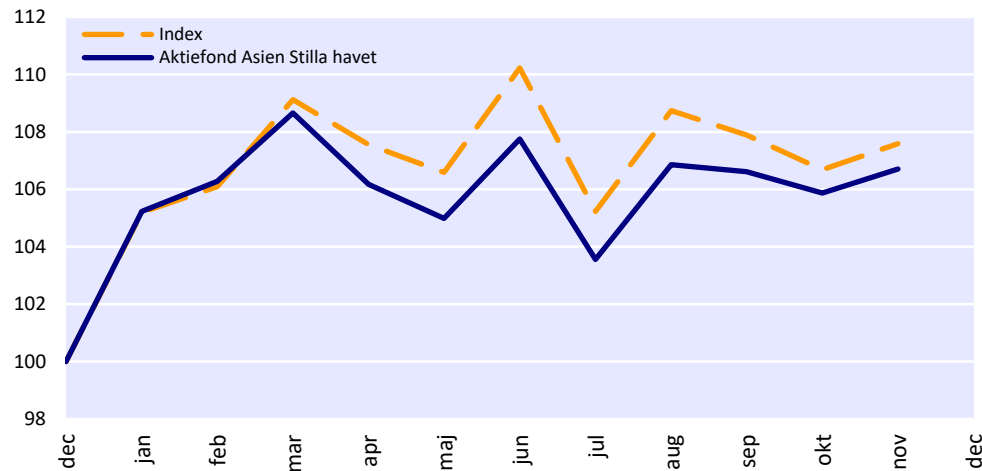


AMF Fonder AB, 113 88 Stockholm
Besöksadress: Klara Södra Kyrkogata 18
Telefon 08-696 31 00
www.amf.se
Org nr 556549-2922 Bolagets säte: Stockholm

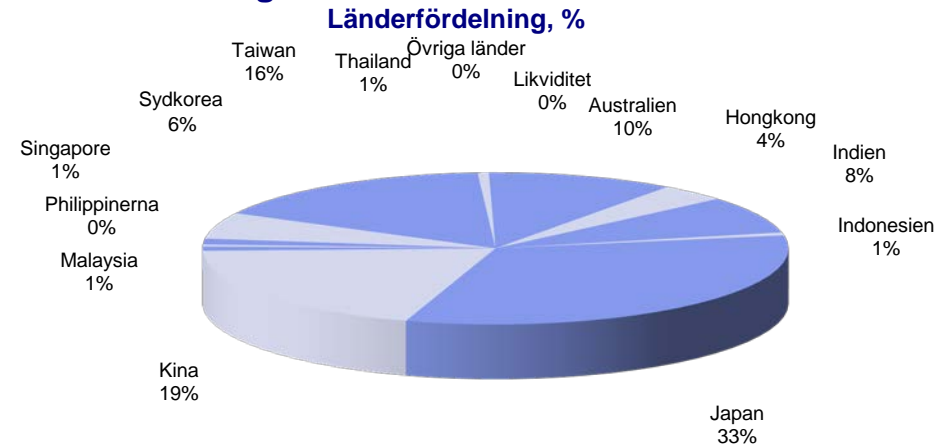
AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Asien och Stillahavsområdet.

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



Placeringar i Aktiefond Asien Stilla havet



Aktiefond Asien Stilla havet	
Totalt antal andelar	6 623 745
Total förmögenhet MSEK	1 901,4
Likviditet *	0,0%
Avkastning från årets början	6,70%
Avkastning Index	7,59%
Nav-kurs	287,05

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	9,4
Tencent Holdings, Kina	5,2
Sony, Japan	4,7
Alibaba Group Holding, Kina	4,5
Shin-Etsu Chemical, Japan	2,5

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
HK Exch. & Cl., Hong Kong	2,5
Mediatek, Taiwan	2,3
Chailease Holding, Taiwan	2,3
East Japan Railway, Japan	2,2
Murata Manufacturing, Japan	2,1
Totalt	37,8

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

AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Perioden 161130-211130 (5 år)*
 Marknadsvärde (MSEK) 1 901,4

Avkastning - portfölj 67,5%
 Avkastning - index 59,3%
 Skillnad 8,2%

Riskindikator 5
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating ** 4
 Volatilitet - portfölj 11,9%
 Volatilitet - index 12,0%
 Aktiv risk 1,4%
 Info. Kvot 0,79
 Sharpekvot - portfölj 0,95
 Jensens alfa 1,2%
 Beta 0,99
 Förklaringsgrad 98,6%
 Konsistens 60,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	1 901,4	1 801,9	1 305,1	918,9	979,3	1 584,8	1 319,4

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Avkastning - portfölj	6,7%	12,3%	28,3%	-5,6%	17,2%	11,1%	6,5%
Avkastning - index	7,6%	6,4%	28,5%	-6,8%	17,6%	13,1%	8,1%
Skillnad	-0,9%	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	0,8%	-0,1%	1,6%	7,9%	43,4%	67,5%	9,1%
Avkastning - index	0,8%	-1,1%	0,9%	7,7%	36,9%	59,3%	9,4%
Skillnad	-0,1%	0,9%	0,7%	0,2%	6,6%	8,2%	-0,3%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

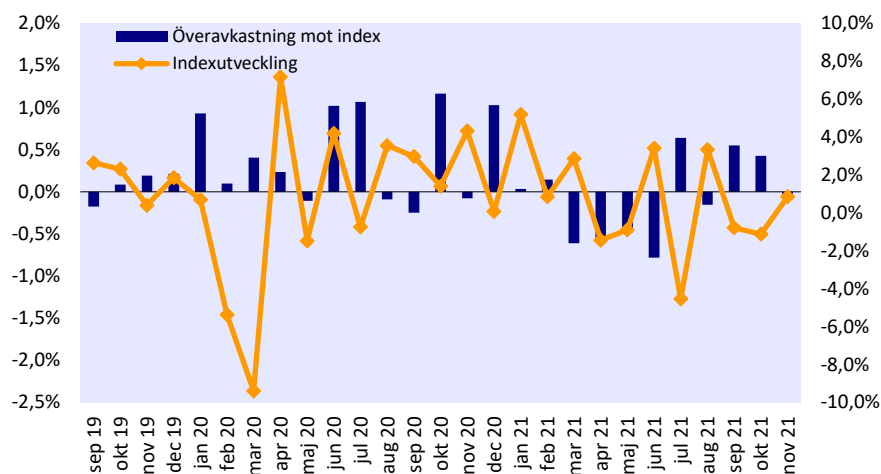
** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

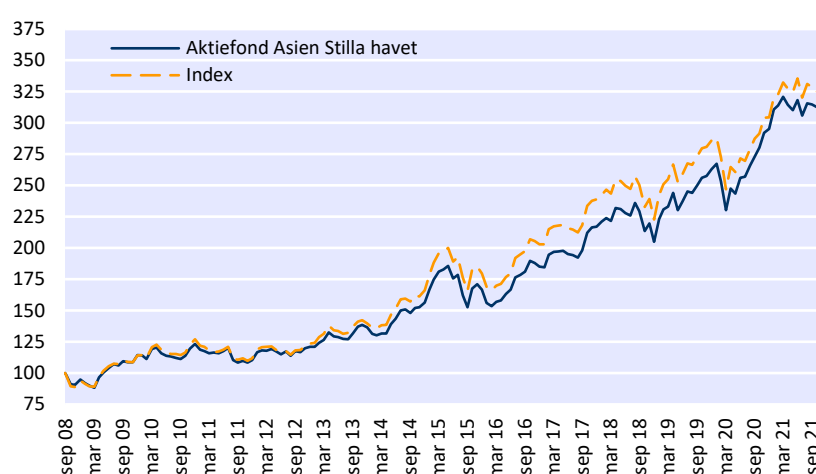
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



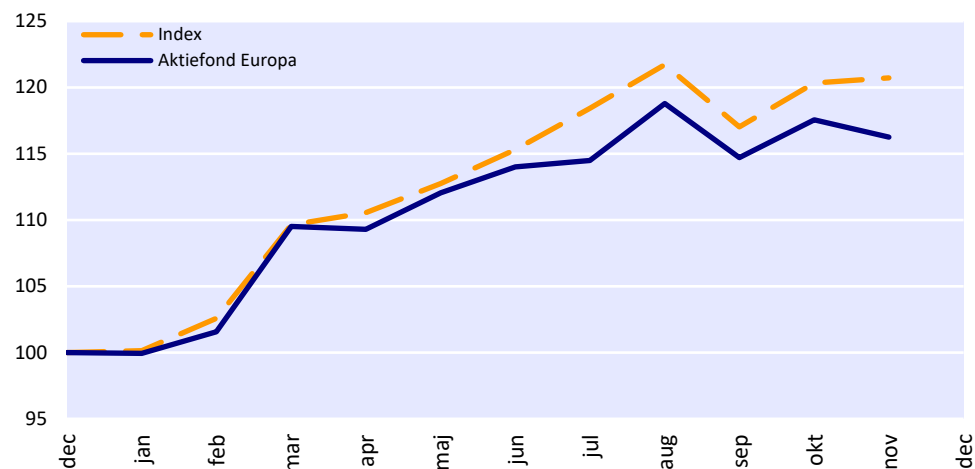
Utveckling fond vs index



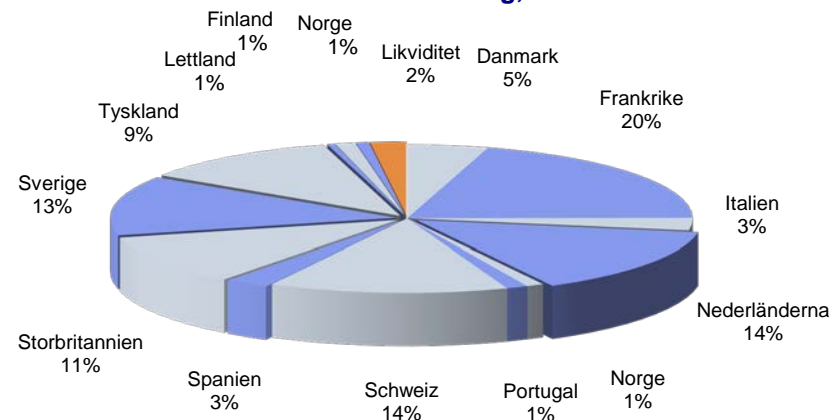
AMF AKTIEFOND EUROPA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Europa.

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



Placeringar i Aktiefond Europa
Länderfördelning, %



Aktiefond Europa	
Totalt antal andelar	24 171 894
Total förmögenhet MSEK	6 496,0
Likviditet *	2,0%
Avkastning från årets början	16,25%
Avkastning Index	20,71%
Nav-kurs	268,74

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
AstraZeneca, Sverige	4,8
ASML, Nederländerna	4,7
Roche, Schweiz	4,5
Allianz, Tyskland	3,5
SAP, Tyskland	3,4

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Novo Nordisk, Danmark	3,1
Air Liquide, Frankrike	3,0
Lloyds, Storbritannien	2,7
Enel, Italien	2,7
ING, Nederländerna	2,6
Totalt	35,1

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

AMF AKTIEFOND EUROPA

Perioden 161130-211130 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	6 496,0

Avkastning - portfölj	61,3%
Avkastning - index	64,9%
Skillnad	-3,5%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	14,4%
Volatilitet - index	14,0%
Aktiv risk	2,6%
Info. kvot	-0,18
Sharpekvot - portfölj	0,73
Jensens alfa	-0,7%
Beta	1,02
Förklaringsgrad	96,7%
Konsistens	56,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	6 496,0	5 480,6	5 611,9	4 362,4	5 558,7	4 162,5	4 157,7

Avkastning - portfölj	16,3%	1,1%	29,6%	-8,9%	12,1%	7,0%	6,4%
Avkastning - index	20,7%	-4,8%	32,5%	-6,2%	11,8%	5,6%	4,7%
Skillnad	-4,5%	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	-1,1%	-2,1%	3,8%	17,1%	40,9%	61,3%	6,3%
Avkastning - index	0,3%	-0,8%	7,1%	21,5%	41,4%	64,9%	5,0%
Skillnad	-1,4%	-1,3%	-3,3%	-4,3%	-0,5%	-3,5%	1,4%

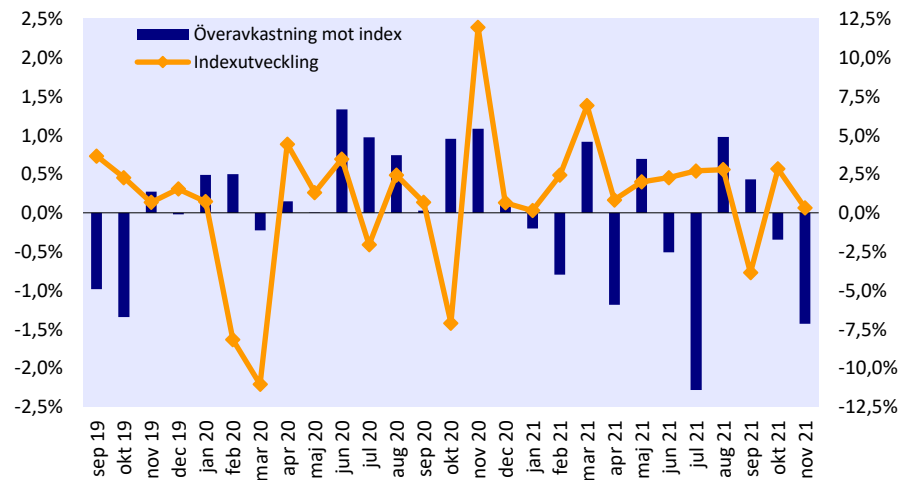
Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Europe NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

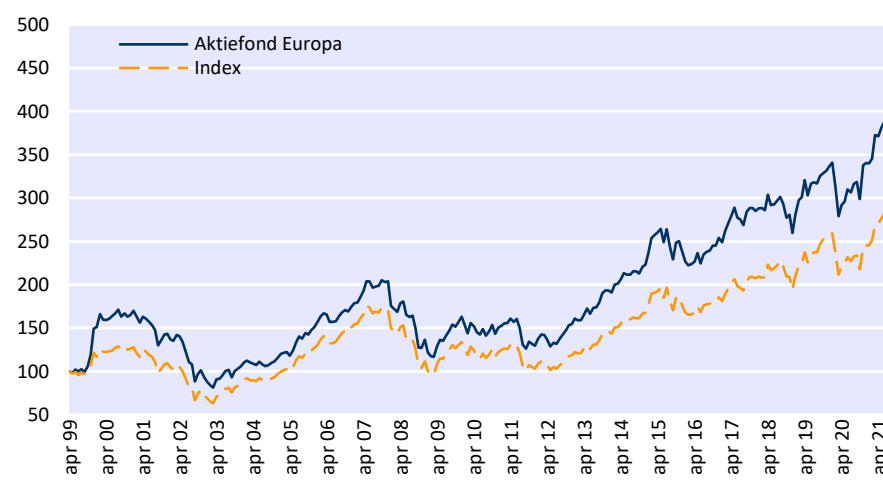
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



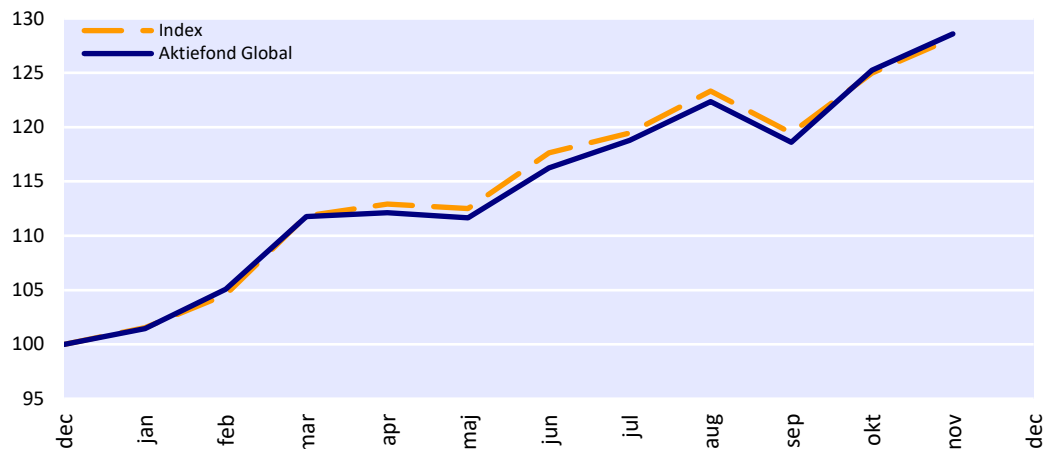
Utveckling fond vs index



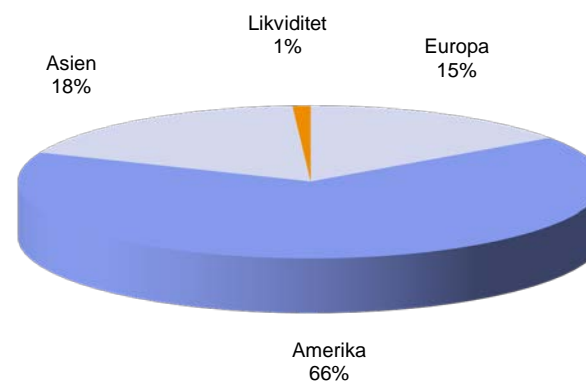
AMF AKTIEFOND GLOBAL

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	94 213 033
Total förmögenhet MSEK	26 711,7
Likviditet *	1,0%
Avkastning från årets början	28,59%
Avkastning Index	28,19%
Nav-kurs	283,52

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft, USA	9,0
Alphabet, USA	7,0
Procter & Gamble, USA	3,7
Adobe, USA	2,7
Tesla, USA	2,6

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	2,5
Berkshire Hathaway, USA	2,4
AstraZeneca, Sverige	2,3
Lam Research, USA	2,2
Nvidia, USA	1,9
Totalt	36,3

AMF AKTIEFOND GLOBAL

Perioden 161130-211130 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 26 711,7

Avkastning - portfölj 99,2%
 Avkastning - index 93,1%
 Skillnad 6,1%

Riskindikator 5
 Hållbarhetsbetyg 4
 Morningstar rating ** 5
 Volatilitet - portfölj 12,7%
 Volatilitet - index 13,4%
 Aktiv risk 1,6%
 Info. kvot 0,44
 Sharpekvot - portfölj 1,20
 Jensens alfa 1,5%
 Beta 0,94
 Förklaringsgrad 98,7%
 Konsistens 48,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	26 711,7	19 221,8	17 424,4	3 657,2	3 522,8	3 188,1	2 507,6

Avkastning - portfölj	28,6%	5,2%	34,7%	-1,1%	10,1%	15,6%	6,7%
Avkastning - index	28,2%	1,8%	34,3%	-1,1%	10,9%	16,2%	5,6%
Skillnad	0,4%	3,5%	0,4%	0,0%	-0,8%	-0,6%	1,1%

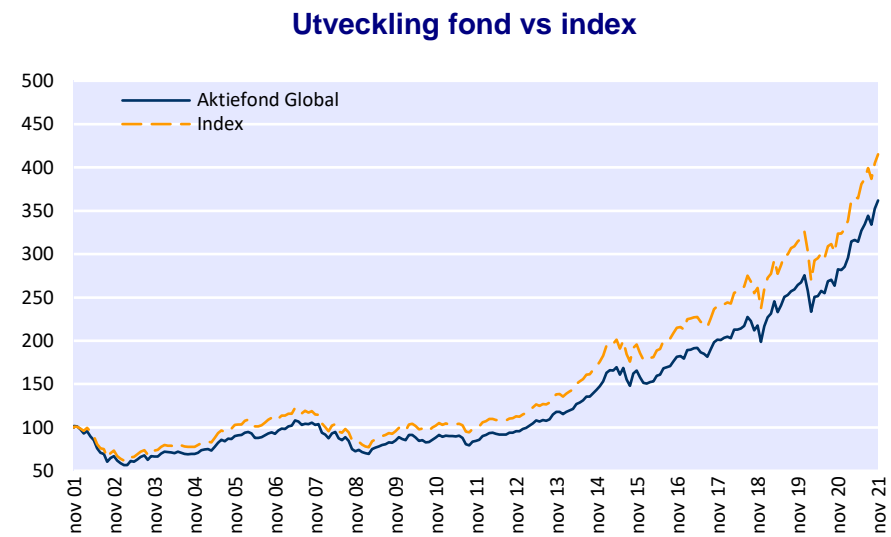
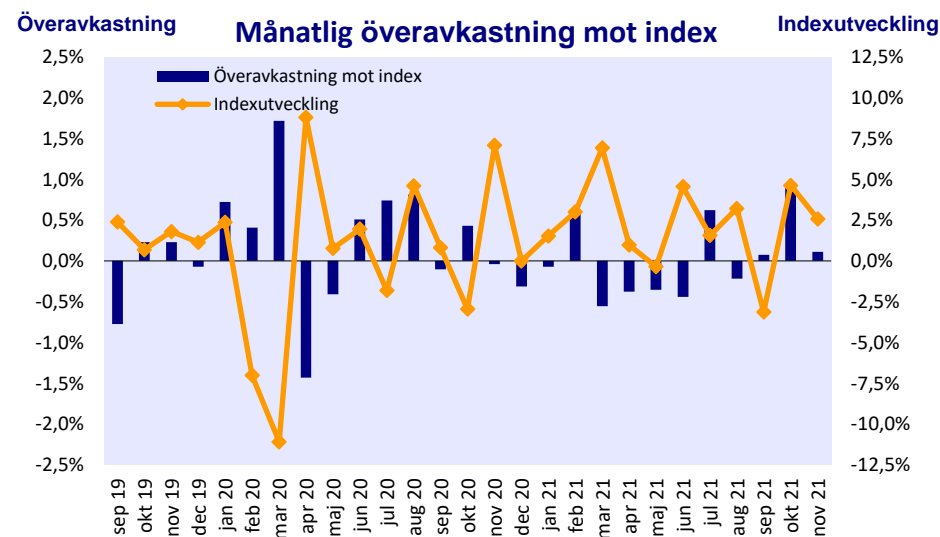
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	2,7%	5,1%	15,2%	28,2%	66,1%	99,2%	6,6%
Avkastning - index	2,6%	4,0%	13,9%	28,2%	59,1%	93,1%	7,4%
Skillnad	0,1%	1,1%	1,2%	0,0%	7,0%	6,1%	-0,7%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

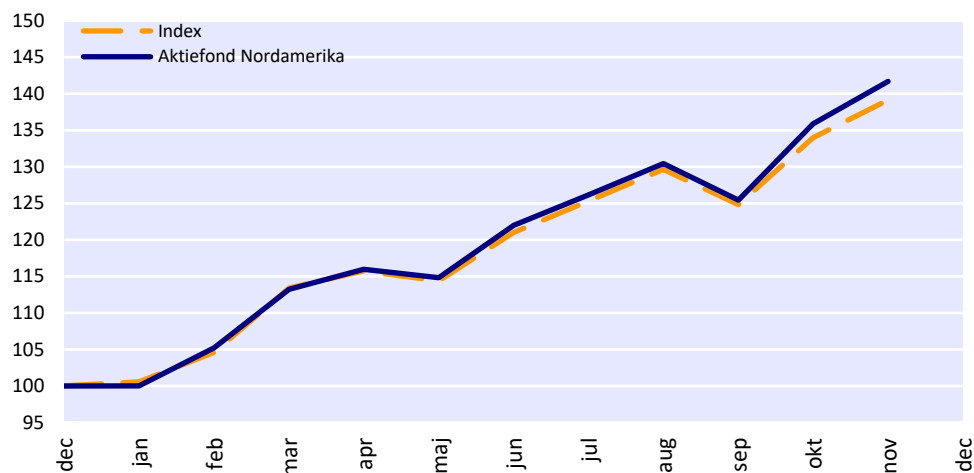
***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



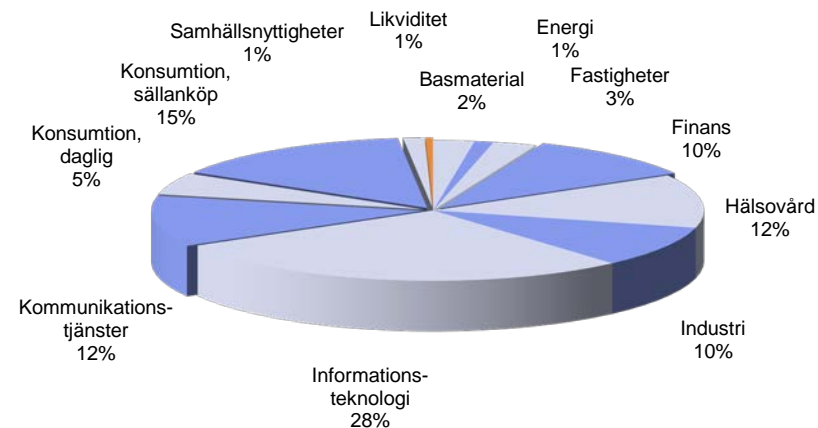
AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

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	10 119 104
Total förmögenhet MSEK	4 763,2
Likviditet *	0,4%
Avkastning från årets början	41,69%
Avkastning Index	39,14%
Nav-kurs	470,71

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft	9,7
Alphabet	9,4
Tesla	4,6
Nvidia	4,2
Procter & Gamble	2,4

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Adobe	2,4
Salesforce	2,2
Visa	2,2
Eli lilly & Company	2,2
Thermo Fischer Scientific	2,2
Totalt	41,6

AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

Perioden 161130-211130 (5 år) *
Marknadsvärde (MSEK) 4 763,2

Avkastning - portfölj 135,0%
Avkastning - index 124,6%
Skillnad 10,4%

Riskindikator 6
Hållbarhetsbetyg 5
Morningstar rating ** 5
Volatilitet - portfölj 14,8%
Volatilitet - index 15,0%
Aktiv risk 1,6%
Info. Kvot 0,68
Sharpekvot - portfölj 1,30
Jensens alfa 1,4%
Beta 0,98
Förklaringsgrad 98,9%
Konsistens 50,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	4 763,2	2 761,4	2 826,5	1 808,6	1 528,3	1 751,1	1 267,5

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Avkastning - portfölj	41,7%	6,2%	39,0%	5,3%	6,9%	18,7%	10,1%
Avkastning - index	39,1%	3,7%	38,2%	4,3%	8,0%	19,6%	8,1%
Skillnad	2,6%	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	4,3%	8,6%	23,4%	40,8%	87,6%	135,0%	12,3%
Avkastning - index	3,9%	7,3%	21,7%	38,6%	77,7%	124,6%	12,9%
Skillnad	0,4%	1,3%	1,7%	2,2%	9,8%	10,4%	-0,7%

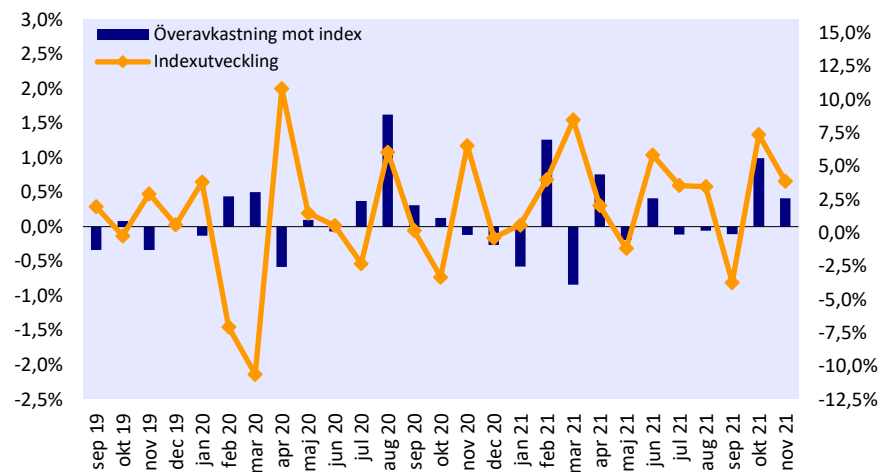
Referensindex: MSCI ESG Leaders USA NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

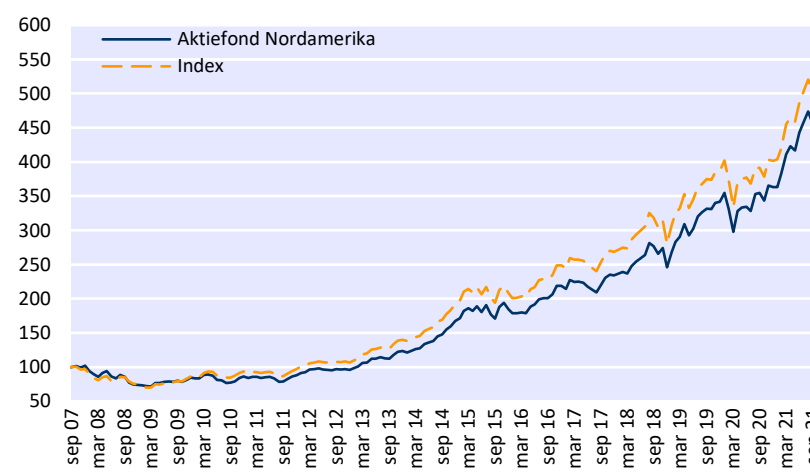
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



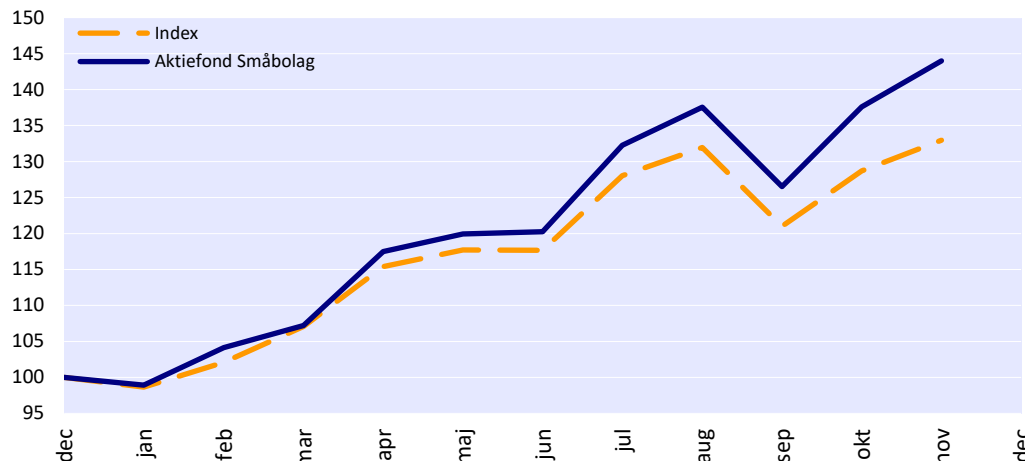
Utveckling fond vs index



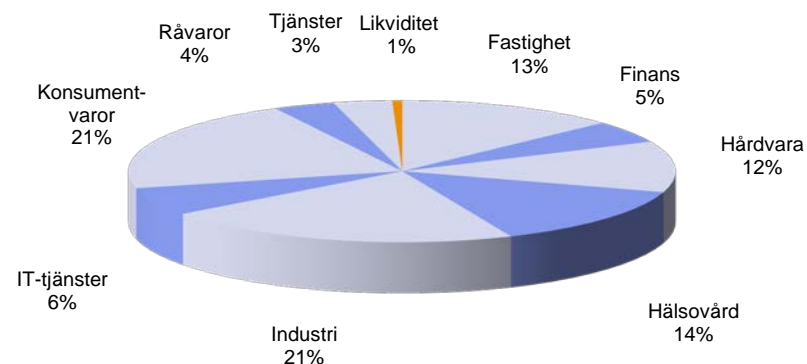
AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

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	16 594 260
Total förmögenhet MSEK	27 928,0
Likviditet *	0,6%
Avkastning från årets början	43,99%
Avkastning index	32,96%
Nav-kurs	1682,99

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Hexatronic	3,3
Mips	3,1
Castellum	3,0
AddLife	2,9
NCAB	2,8

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Sagax	2,7
Avanza	2,7
Medicover	2,7
HMS Networks	2,5
Beijer Ref	2,5
Totalt	28,3

AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

Perioden 161130-211130 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	27 928,0
Avkastning - portfölj	220,0%
Avkastning - index	163,1%
Skillnad	56,9%
Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	17,9%
Volatilitet - index	18,0%
Aktiv risk	4,0%
Info. kvot	1,22
Sharpekvot - portfölj	1,49
Jensens alfa	5,1%
Beta	0,99
Förklaringsgrad	95,0%
Konsistens	63,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	27 928,0	16 069,7	9 803,5	6 723,3	7 358,6	6 492,9	5 666,5
Avkastning - portfölj	44,0%	41,5%	42,2%	-2,6%	9,6%	13,0%	34,2%
Avkastning - index	33,0%	23,0%	43,2%	-0,2%	8,8%	12,2%	30,1%
Skillnad	11,0%	18,5%	-1,0%	-2,4%	0,8%	0,9%	4,2%

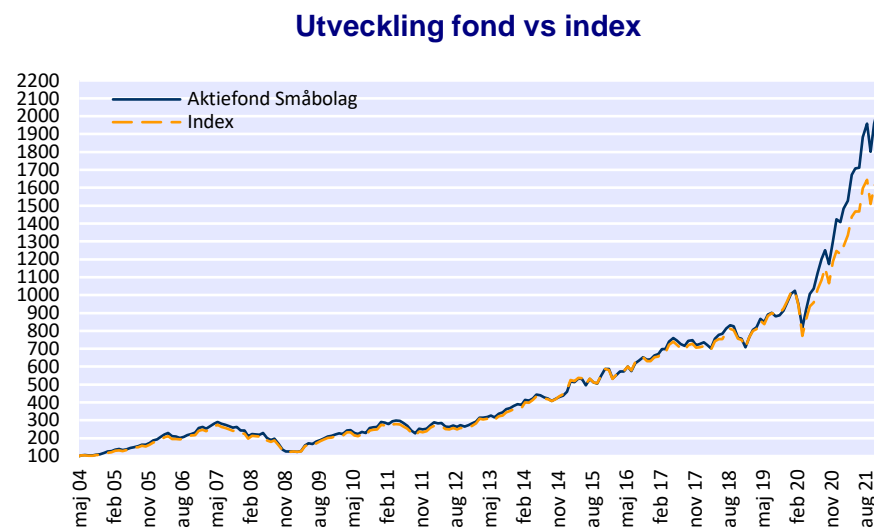
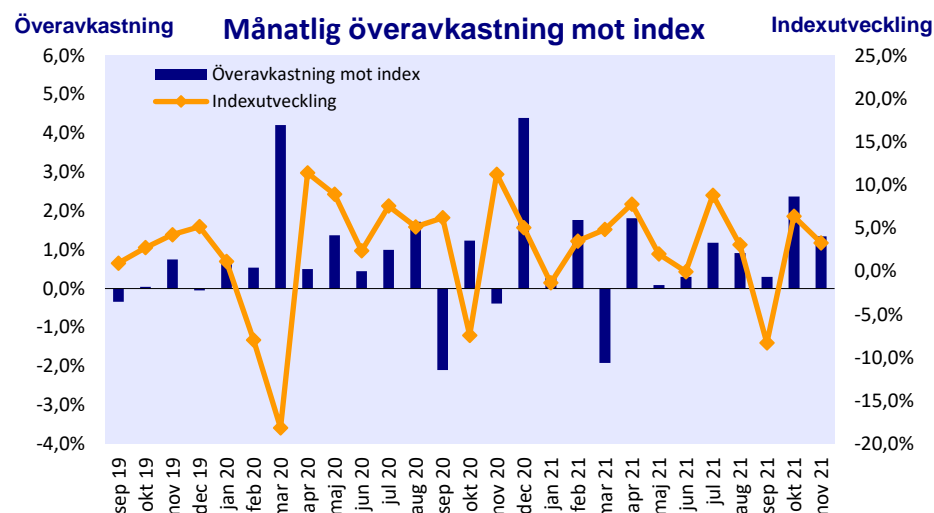
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	4,6%	4,7%	20,1%	57,6%	171,4%	220,0%	18,8%
Avkastning - index	3,3%	0,8%	13,0%	39,7%	121,0%	163,1%	17,4%
Skillnad	1,3%	3,9%	7,1%	17,9%	50,4%	56,9%	1,4%

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

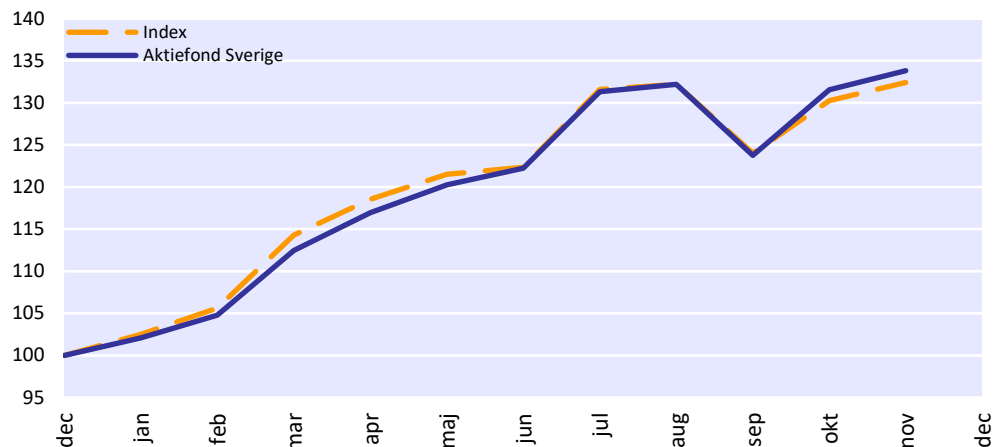
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



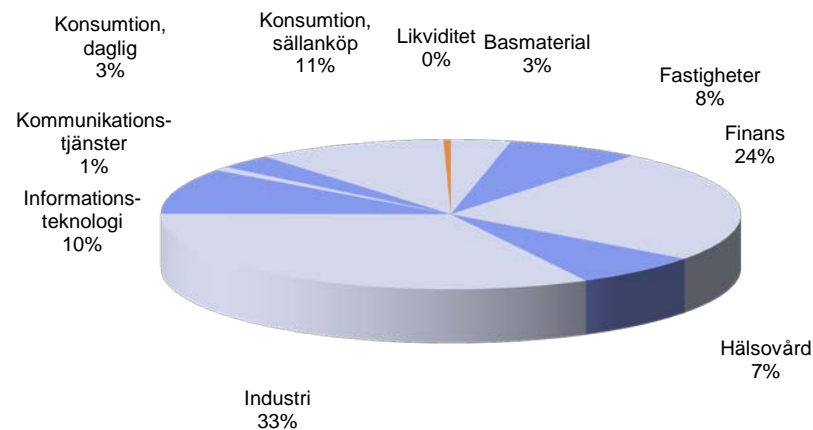
AMF AKTIEFOND SVERIGE

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	49 084 745
Total förmögenhet MSEK	48 263,7
Likviditet *	0,4%
Avkastning från årets början	33,82%
Avkastning Index	32,42%
Nav-kurs	983,27

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: SIXPRX

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	9,6
Atlas Copco	6,0
SEB	6,0
Volvo	4,6
Hexagon	4,4

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Epiroc	4,0
Indutrade	3,8
Latour	3,1
Essity	3,1
Nibe	3,0
Totalt	47,6

AMF AKTIEFOND SVERIGE

Perioden 161130-211130 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 48 263,7

Avkastning - portfölj 99,7%
 Avkastning - index 121,7%
 Skillnad -22,0%

Riskindikator 6
 Hållbarhetsbetyg 4
 Morningstar rating ** 3
 Volatilitet - portfölj 15,6%
 Volatilitet - index 15,4%
 Aktiv risk 1,9%
 Info. kvot -1,28
 Sharpekvot - portfölj 0,98
 Jensens alfa -2,5%
 Beta 1,00
 Förklaringsgrad 98,5%
 Konsistens 35,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	48 263,7	37 056,3	33 846,3	25 371,6	27 691,6	27 500,3	26 529,6

Avkastning - portfölj	33,8%	11,7%	25,7%	-4,9%	7,9%	8,6%	8,6%
Avkastning - index	32,4%	14,8%	35,0%	-4,6%	10,0%	9,2%	6,3%
Skillnad	1,4%	-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	1,7%	1,2%	11,3%	35,3%	76,6%	99,7%	12,6%
Avkastning - index	1,7%	0,2%	9,0%	34,2%	93,2%	121,7%	10,9%
Skillnad	0,1%	1,1%	2,3%	1,1%	-16,5%	-22,0%	1,7%

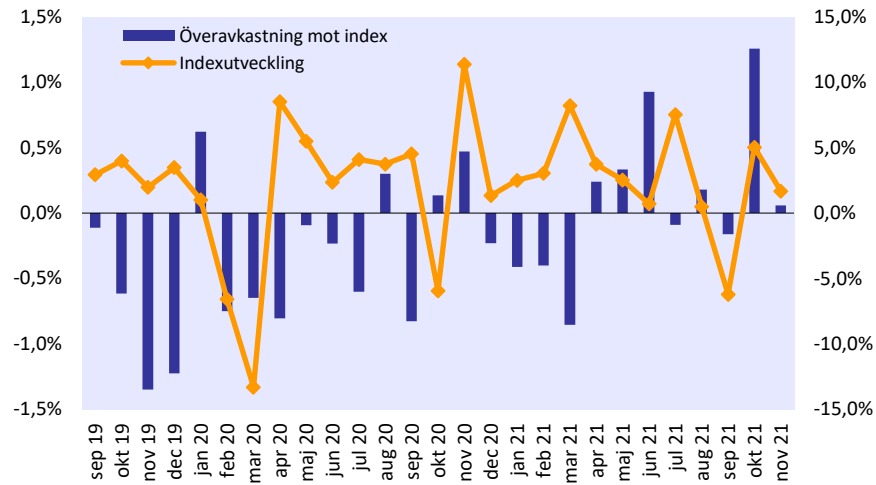
Referensindex: SIXPRX

* Alla värden beräknas inkl avgifter

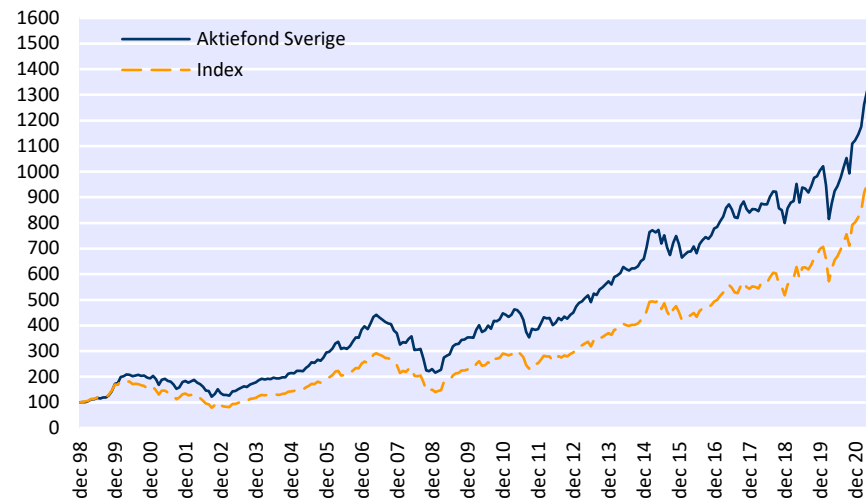
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



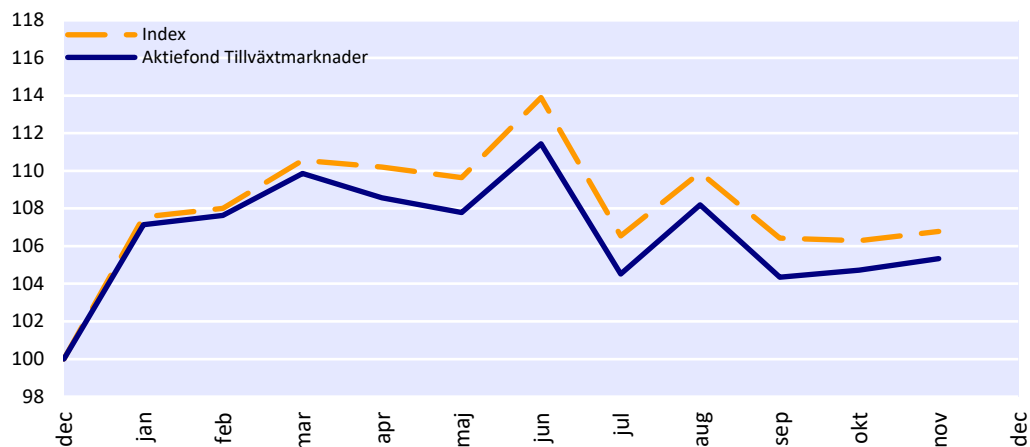
Utveckling fond vs index



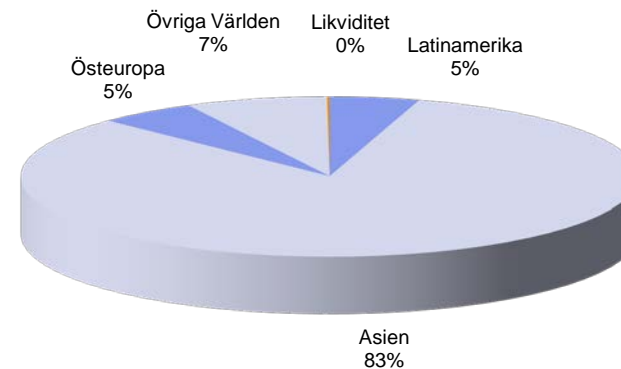
AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

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	17 142 139
Total förmögenhet MSEK	2 033,4
Likviditet *	0,1%
Avkastning från årets början	5,34%
Avkastning Index	6,79%
Nav-kurs	118,62

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	9,7
Tencent Holdings, Kina	8,0
Alibaba Group Holding, Kina	6,3
Reliance Industries, Indien	3,5
Mediatek, Taiwan	2,7

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Meituan Dianping, Kina	2,5
Chailease Holding, Taiwan	2,3
Infosys, Indien	2,2
Housing Dev. Finance, Indien	1,7
China Construction Bank, Kina	1,6
	40,7

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

AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

Perioden 191211-211130 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK)	2 033,4
Avkastning - portfölj	18,6%
Avkastning - index	17,5%
Skillnad	1,1%

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⁾	50,0%

	2021	2020	2019
Marknadsvärde (MSEK)	2 033,4	1 653,4	322,2

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

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

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

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

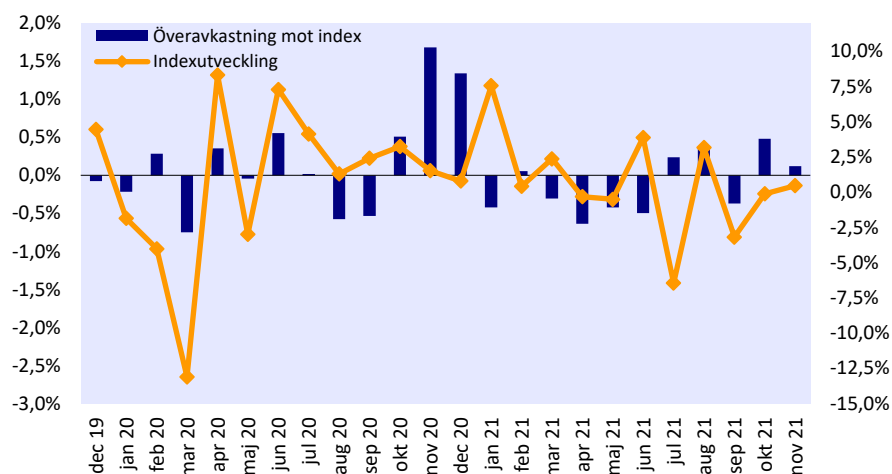
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

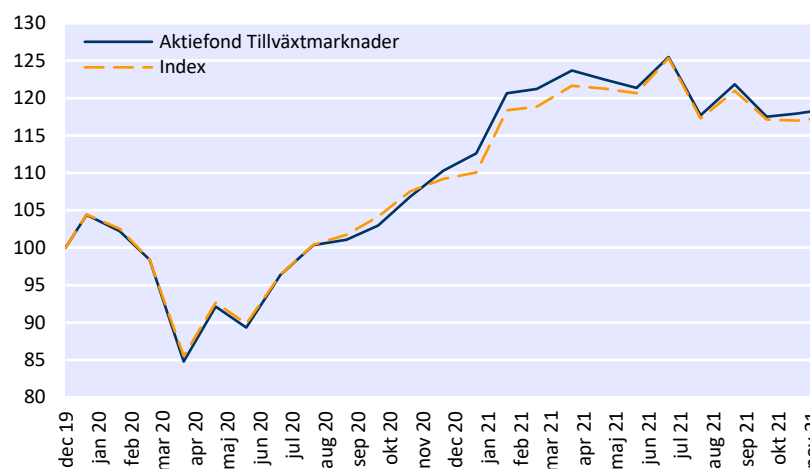
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



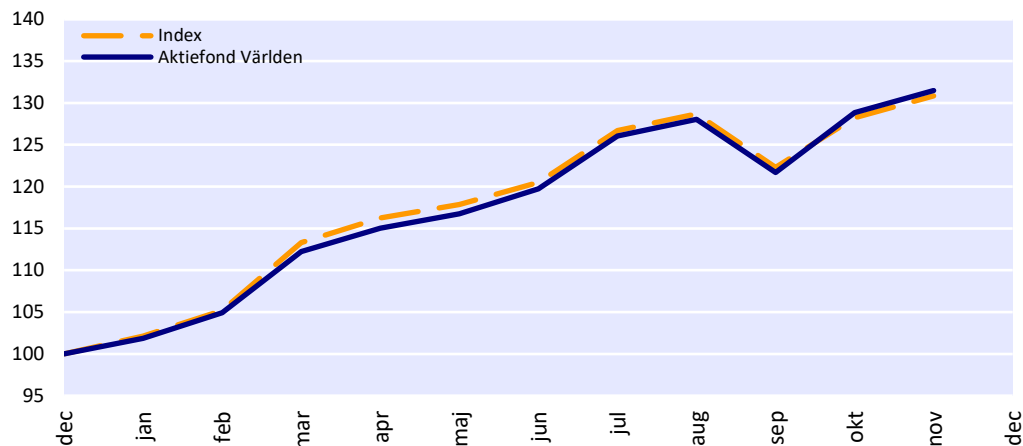
Utveckling fond vs index



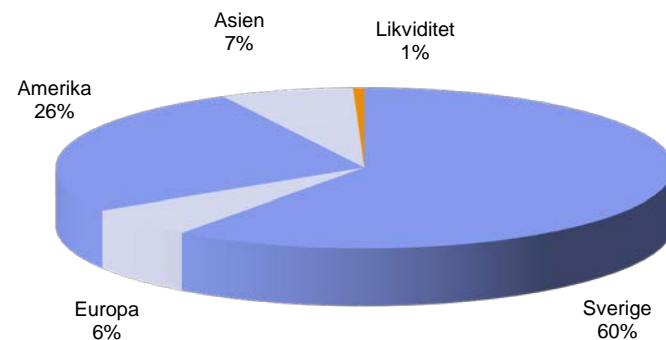
AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

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	82 406 835
Total förmögenhet MSEK	52 420,5
Likviditet *	0,6%
Avkastning från årets början	31,49%
Avkastning Index	30,84%
Nav-kurs	636,12

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	5,5
Microsoft, USA	3,5
SEB	3,4
Atlas Copco	3,3
Alphabet, USA	2,7

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Volvo	2,6
Hexagon	2,5
Epiroc	2,4
Indutrade	2,3
AstraZeneca	2,1
Totalt	30,3

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

AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

Perioden 161130-211130 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	52 420,5

Avkastning - portfölj	94,5%
Avkastning - index	110,7%
Skillnad	-16,2%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	3
Volatilitet - portfölj	14,0%
Volatilitet - index	14,1%
Aktiv risk	1,5%
Info. kvot	-1,25
Sharpekvot - portfölj	1,05
Jensens alfa	-1,7%
Beta	0,99
Förklaringsgrad	98,9%
Konsistens	38,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	52 420,5	41 075,8	39 160,8	31 486,5	33 731,8	32 024,0	29 410,8

Avkastning - portfölj	31,5%	8,0%	28,3%	-3,7%	8,1%	11,6%	8,7%
Avkastning - index	30,8%	9,6%	34,8%	-3,2%	10,5%	12,0%	6,0%
Skillnad	0,6%	-1,5%	-6,5%	-0,5%	-2,4%	-0,4%	2,7%

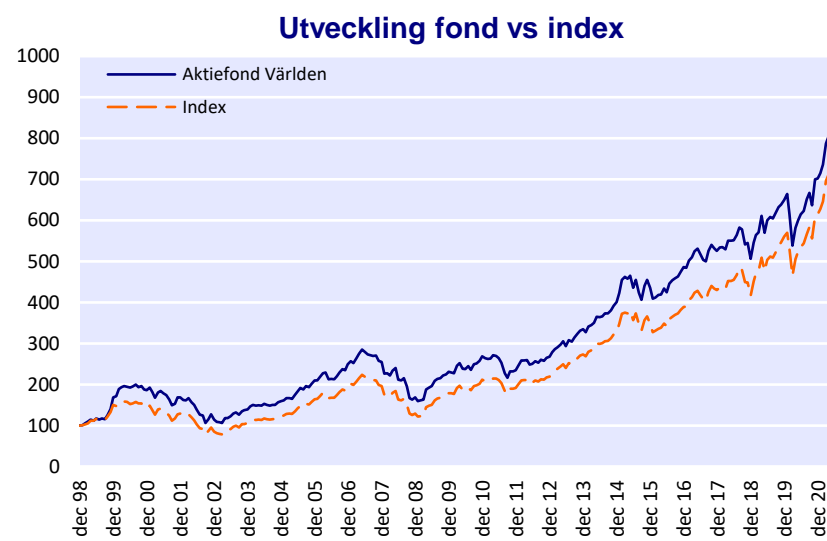
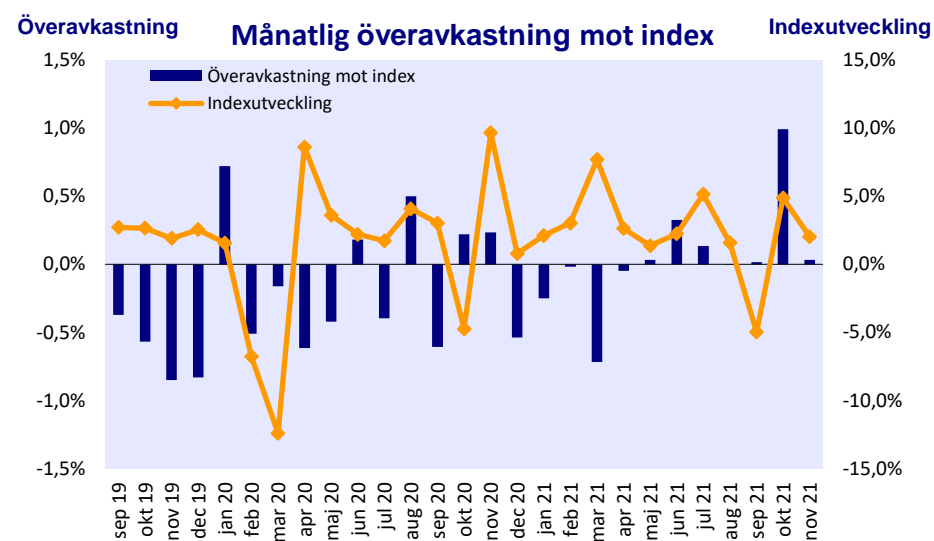
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	2,1%	2,7%	12,6%	31,8%	69,2%	94,5%	10,2%
Avkastning - index	2,0%	1,7%	11,0%	31,9%	79,3%	110,7%	9,5%
Skillnad	0,0%	1,0%	1,6%	-0,1%	-10,1%	-16,2%	0,7%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

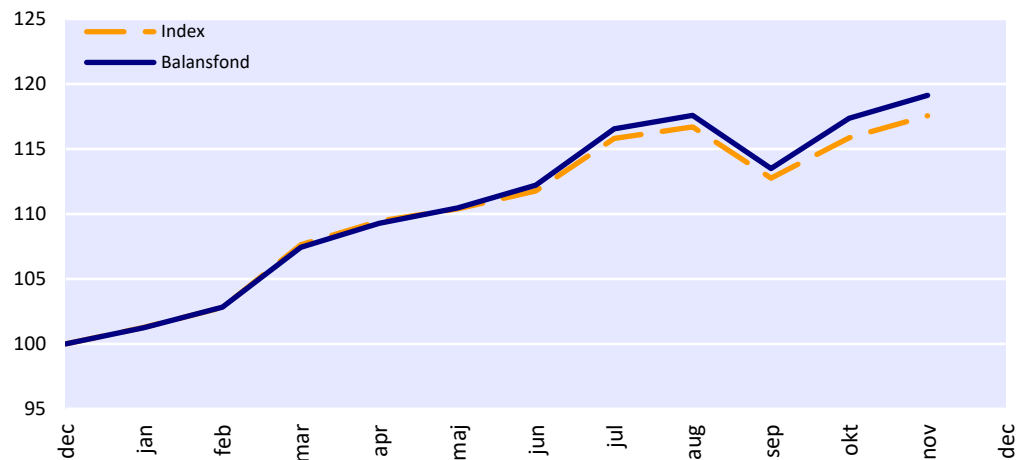
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



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	72 546 153
Total förmögenhet MSEK	28 315,9
Likviditet *	0,9%
Modifierad duration	3,74%
Avkastning från årets början	19,12%
Avkastning Index	17,55%
Nav-kurs	390,32

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	4,0
SEB	2,5
Atlas Copco	2,5
Volvo	1,9
Hexagon	1,8
Totalt	12,6

Största ränteb. Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	7,2
SBAB	3,3
SEB Bolån	2,8
Castellum	2,1
Klarna Bank	2,1
Totalt	17,5

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

AMF BALANSFOND

Perioden 161130-211130 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 28 315,9

Avkastning - portfölj 54,6%
 Avkastning - index 61,3%
 Skillnad -6,6%

Riskindikator 4
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating ** 5
 Volatilitet - portfölj 9,0%
 Volatilitet - index 8,6%
 Aktiv risk 1,1%
 Info. kvot -0,87
 Sharpekvot - portfölj 1,07
 Jensens alfa -1,3%
 Beta 1,04
 Förklaringsgrad 98,7%
 Konsistens 38,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	28 315,9	23 820,1	23 265,8	20 513,5	21 734,7	21 288,0	20 303,8

Avkastning - portfölj	19,1%	6,0%	16,9%	-1,9%	5,2%	8,3%	5,6%
Avkastning - index	17,6%	7,3%	20,5%	-1,5%	6,4%	8,1%	4,1%
Skillnad	1,6%	-1,3%	-3,7%	-0,5%	-1,2%	0,1%	1,4%

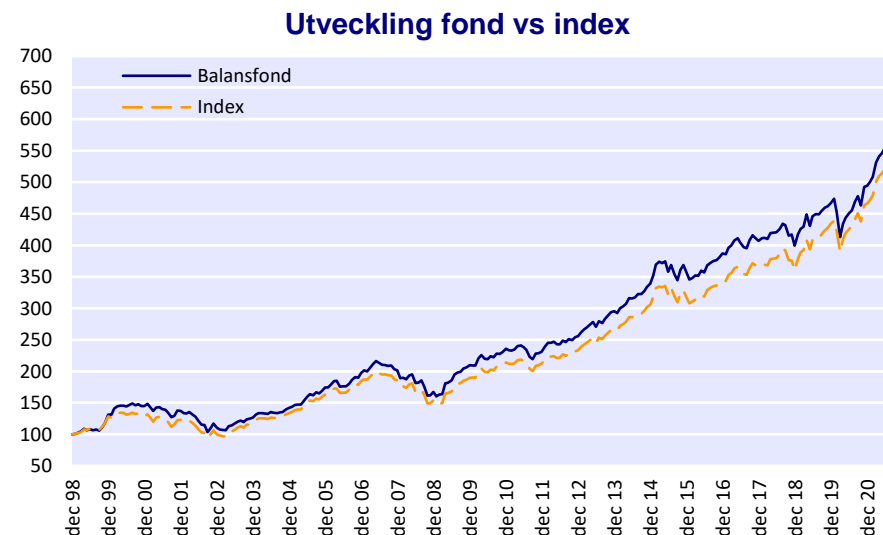
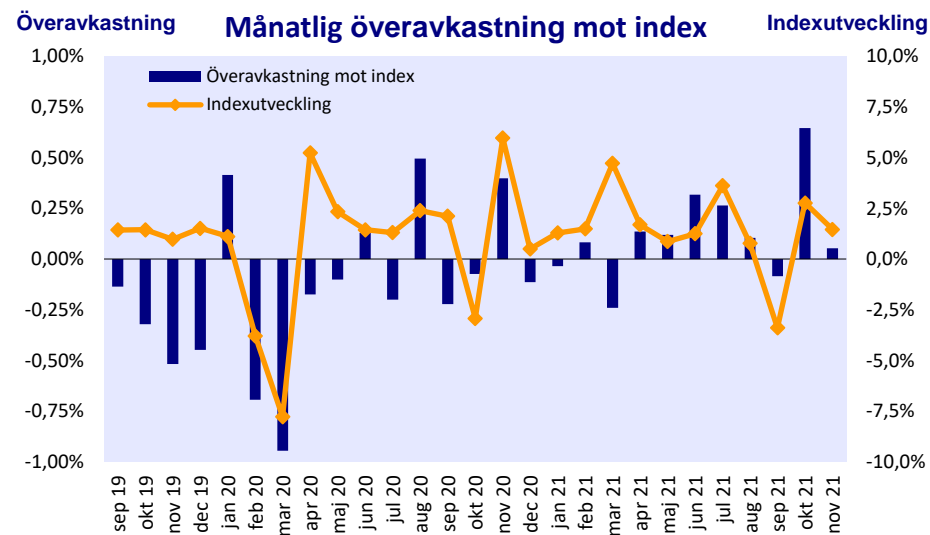
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	1,5%	1,3%	7,8%	19,6%	41,4%	54,6%	8,0%
Avkastning - index	1,5%	0,7%	6,5%	18,1%	45,7%	61,3%	7,7%
Skillnad	0,1%	0,6%	1,4%	1,4%	-4,3%	-6,6%	0,3%

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

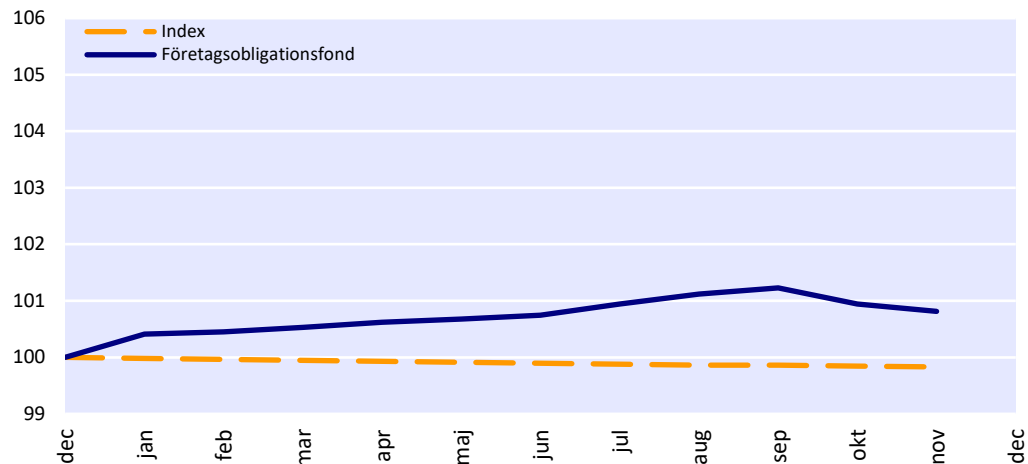
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



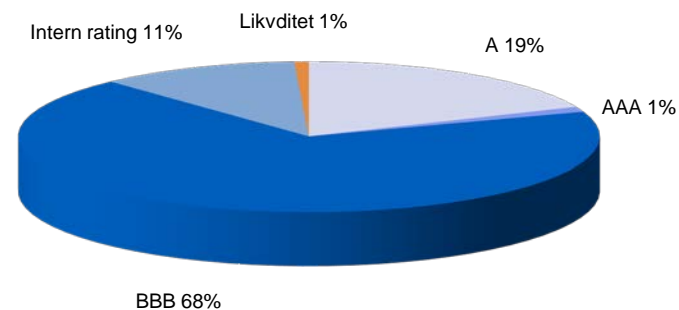
AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

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	9 023 025
Total förmögenhet MSEK	925,4
Likviditet *	0,8%
Duration	0,78
Modifierad duration	0,77%
Modifierad duration krediter	0,77%
Yield	1,00%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	3,03
Avkastning från årets början	0,82%
Avkastning index	-0,17%
Nav-kurs	102,56

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Atrium Ljungberg	7,8
Klarna Bank	6,5
Castellum	6,0
Svensk Fastighetsfinansiering	4,9
Hexagon	4,8
	30,0

AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

Perioden 180829-211130 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK) 925,4

Avkastning - portfölj 2,56%

Avkastning - index -1,17%

Skillnad 3,73%

Riskindikator ³⁾ 1

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating 2

Volatilitet - portfölj ³⁾ 1,7%

Volatilitet - index ³⁾ 0,1%

Aktiv risk ²⁾ 2,1%

Info. Kvot ²⁾ 0,55

Sharpekvot - portfölj ²⁾ 0,75

Jensens alfa ²⁾ 0,8%

Beta ²⁾ 3,68

Förklaringsgrad ²⁾ 1,7%

Konsistens ²⁾ 75,0%

	2021	2020	2019	2018
Marknadsvärde (MSEK)	925,4	700,1	641,8	536,5

Avkastning - portfölj 0,82% 0,99% 1,60% -0,86%

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

Skillnad 0,98% 1,17% 2,13% -0,56%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	Start ⁴⁾
Avkastning - portfölj	-0,13%	-0,30%	0,14%	1,07%	3,26%	0,78%
Avkastning - index	-0,02%	-0,03%	-0,08%	-0,18%	-0,96%	-0,36%
<i>Skillnad</i>	-0,11%	-0,27%	0,22%	1,25%	4,22%	1,14%

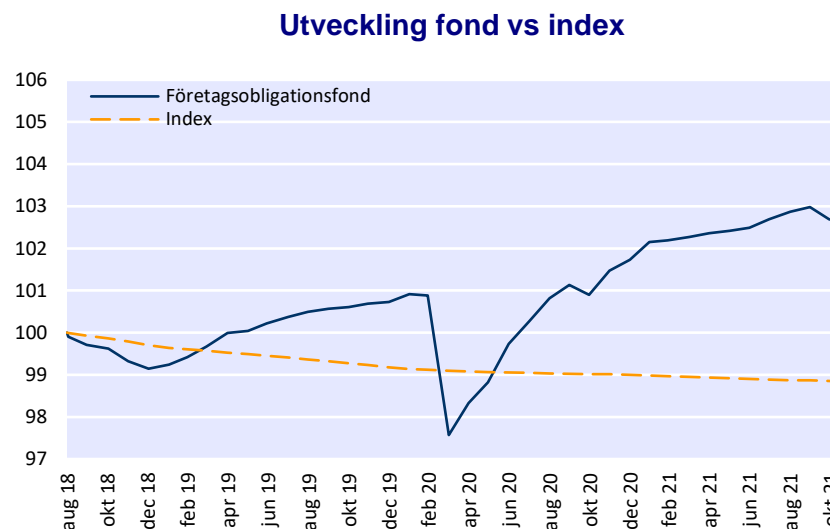
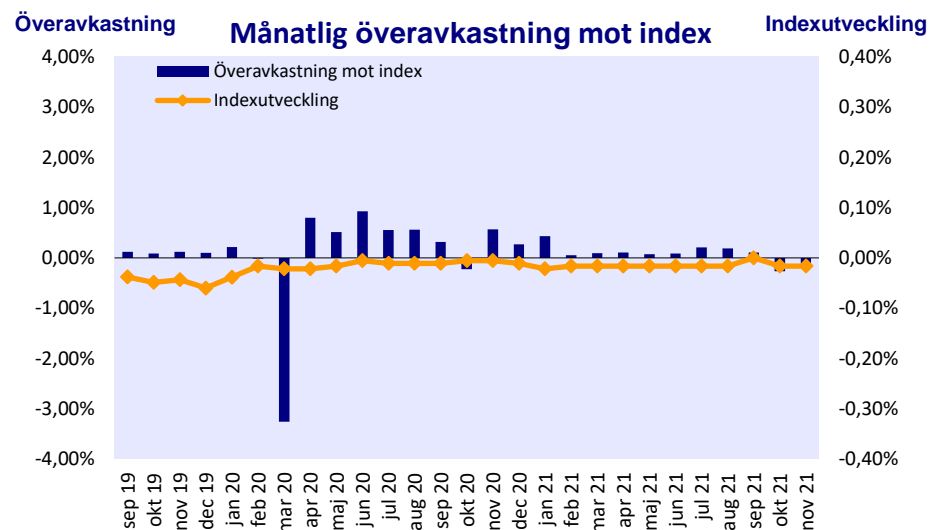
Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

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

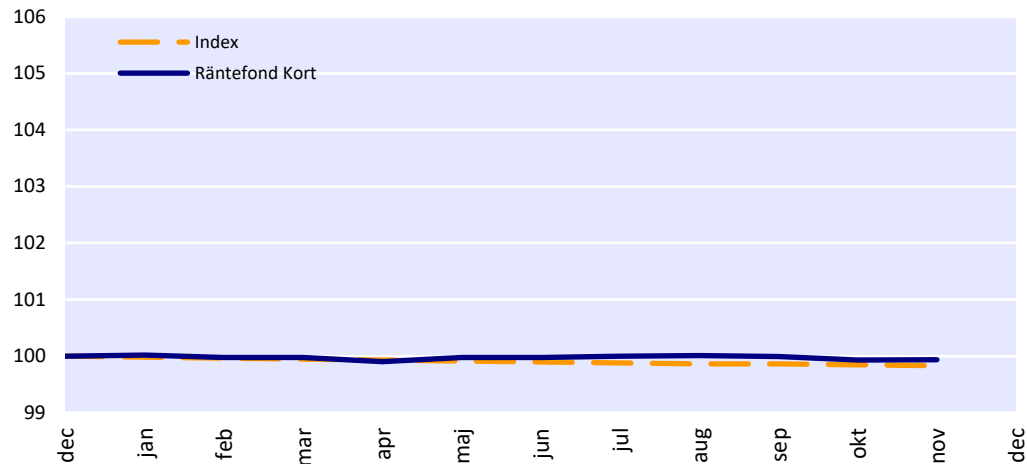
⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



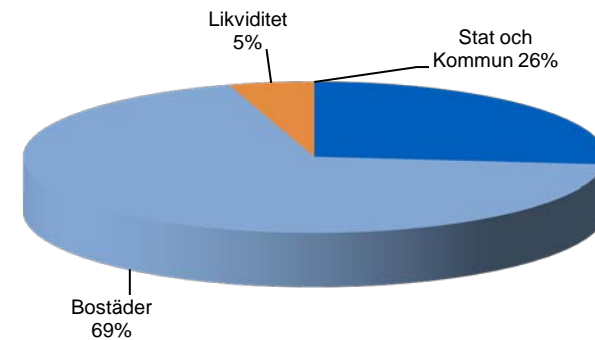
AMF RÄNTEFOND KORT

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 statsskuldväxlar samt i instrument utgivna av banker, bostadsfinansieringsinstitut och andra kreditvärda företag och organisationer.

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



Placeringar i Råntefond Kort
Emittentfördelning, %



Råntefond Kort	
Totalt antal andelar	54 309 470
Total förmögenhet MSEK	6 053,6
Likviditet *	4,8%
Duration	0,75
Modifierad duration	0,75%
Modifierad duration krediter	0,75%
Yield	0,00%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	1,97
Avkastning från årets början	-0,06%
Avkastning index	-0,17%
Nav-kurs	111,47

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Kommuninvest	18,5
Skandiabanken	14,7
Nykredit	13,9
Landshypotek	10,8
Realkredit	7,3
	65,1

AMF RÄNTEFOND KORT

Perioden 161130-211130 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 6 053,6

Avkastning - portfölj -0,92%

Avkastning - index -2,50%

Skillnad 1,58%

Riskindikator 1

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating ** -

Volatilitet - portfölj 0,2%

Volatilitet - index 0,1%

Aktiv risk 0,2%

Info. kvot 1,98

Sharpekvot - portfölj 1,81

Jensens alfa 0,3%

Beta 0,85

Förklaringsgrad 17,0%

Konsistens 86,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	6 053,6	5 582,1	4 443,6	5 252,2	4 834,0	5 384,6	6 380,6

Avkastning - portfölj -0,06% 0,27% -0,30% -0,46% -0,34% 0,07% -0,37%

Avkastning - index -0,17% -0,17% -0,53% -0,81% -0,77% -0,66% -0,27%

Skillnad 0,11% 0,44% 0,23% 0,34% 0,43% 0,73% -0,10%

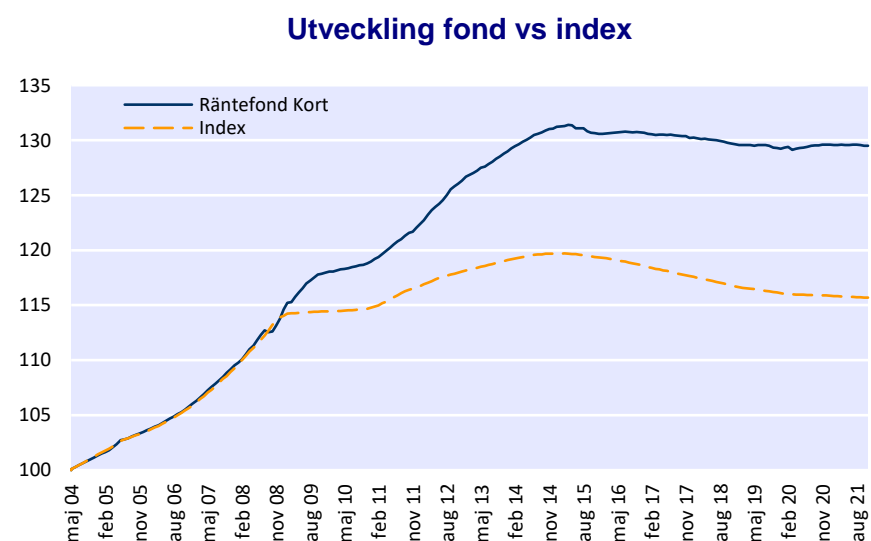
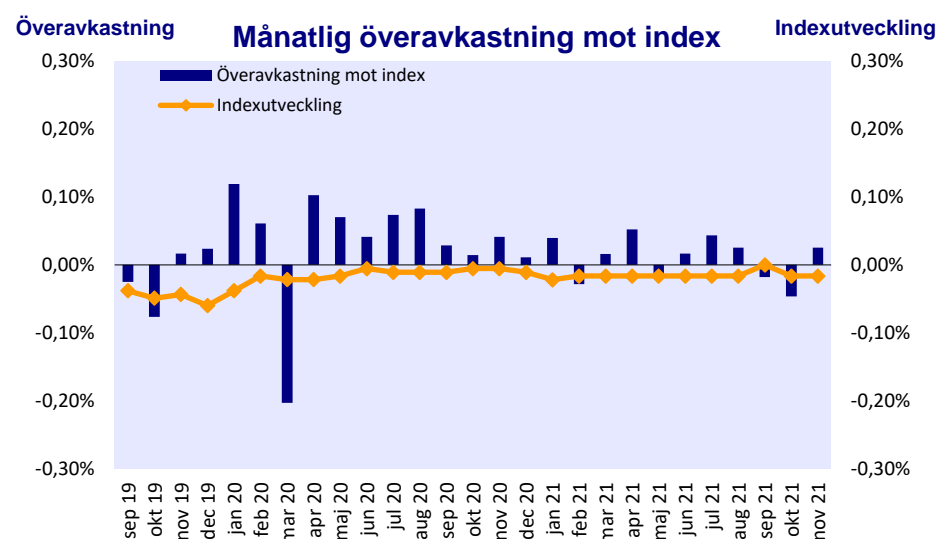
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,01%	-0,07%	-0,04%	-0,06%	-0,15%	-0,92%	1,48%
Avkastning - index	-0,02%	-0,03%	-0,08%	-0,18%	-0,96%	-2,50%	0,83%
Skillnad	0,03%	-0,04%	0,05%	0,12%	0,80%	1,58%	0,65%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

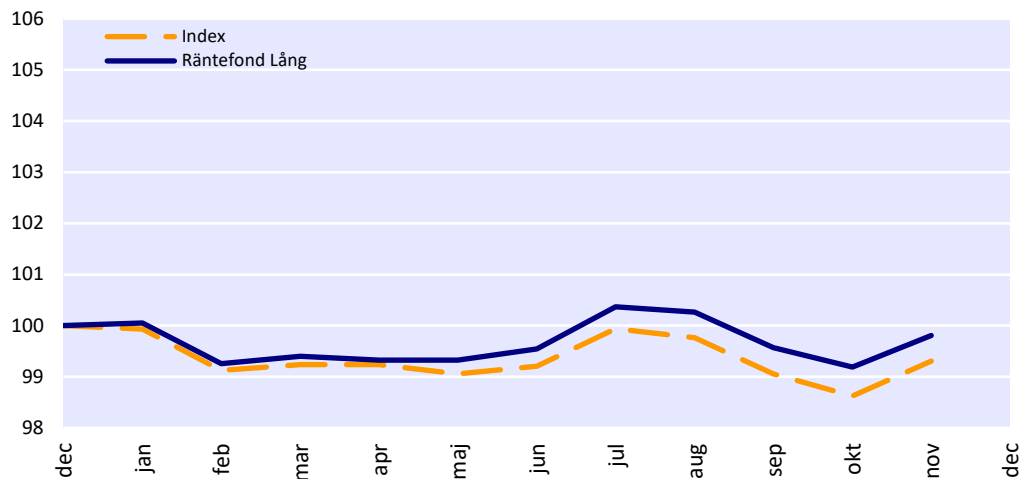
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



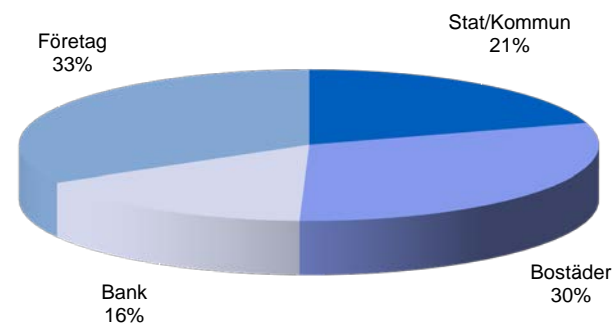
AMF RÄNTEFOND LÅNG

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	58 976 617
Total förmögenhet MSEK	8 944,9
Likviditet *	-7,2%
Duration	4,07
Modifierad duration	4,05%
Modifierad duration krediter	2,33%
Yield	0,49%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	4,16
Avkastning från årets början	-0,19%
Avkastning Index	-0,69%
Nav-kurs	151,67

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	20,7
SBAB	10,3
SEB Bolån	9,1
LF Hypotek	6,0
Klarna Bank	5,4
Totalt	51,5

AMF RÄNTEFOND LÅNG

Perioden 161130-211130 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 8 944,9

Avkastning - portfölj 5,4%

Avkastning - index 3,2%

Skillnad 2,2%

Riskindikator 2

Hållbarhetsbetyg 4

Morningstar rating ** 5

Volatilitet - portfölj 1,7%

Volatilitet - index 1,4%

Aktiv risk 0,7%

Info. kvot 0,63

Sharpekvot - portfölj 0,94

Jensens alfa 0,3%

Beta 1,09

Förklaringsgrad 84,2%

Konsistens 83,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	8 944,9	8 859,8	8 621,8	8 077,9	6 970,1	7 328,8	6 501,6

Avkastning - portfölj -0,2% 2,0% 1,7% 1,2% 0,7% 3,3% 0,5%

Avkastning - index -0,7% 1,4% 1,2% 1,0% 0,4% 2,8% 0,5%

Skillnad 0,5% 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	0,6%	-0,5%	0,5%	-0,2%	3,6%	5,4%	4,0%
Avkastning - index	0,7%	-0,5%	0,3%	-0,8%	1,9%	3,2%	3,8%
Skillnad	-0,1%	0,0%	0,2%	0,6%	1,6%	2,2%	0,2%

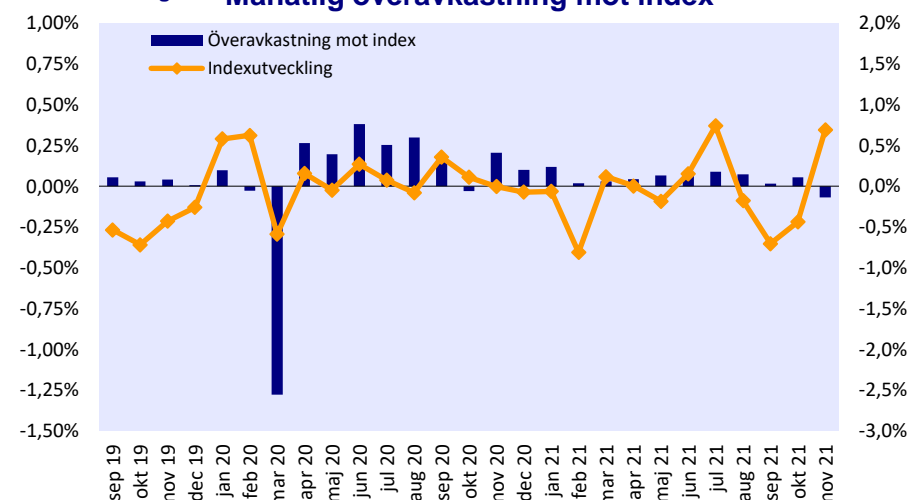
Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

* Alla värden beräknas inkl avgifter

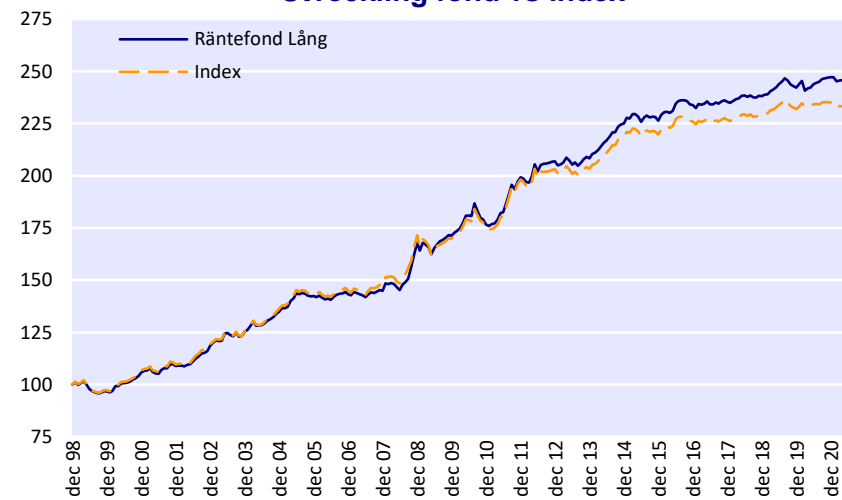
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



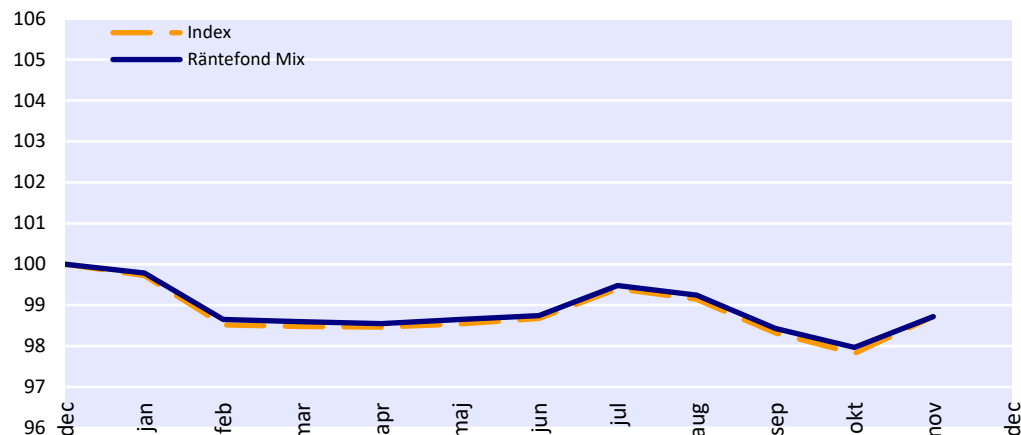
Utveckling fond vs index



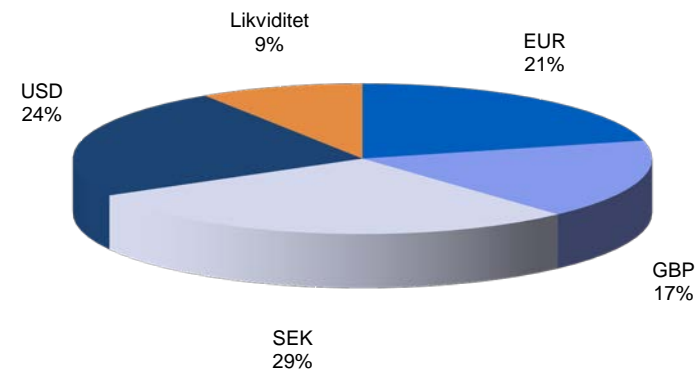
AMF RÄNTEFOND MIX

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 Rente Fond Mix
Emittentfördelning, %



Rente Fond Mix	
Totalt antal andelar	28 209 045
Total förmögenhet MSEK	3 371,7
Likviditet *	9,2%
Duration	4,24
Modifierad duration	4,23%
Modifierad duration krediter	1,12%
Yield	0,29%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	4,49
Avkastning från årets början	-1,28%
Avkastning Index	-1,28%
Nav-kurs	119,52

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Stat USA	21,7
Stat Tyskland	16,8
Stat Storbritannien	16,8
Stat Sverige	15,4
Stat Italien	3,8
	74,5

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 161130-211130 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 3 371,7

Avkastning - portfölj 2,7%
 Avkastning - index 1,9%
 Skillnad 0,8%

Riskindikator 2
 Hållbarhetsbetyg 4
 Morningstar rating ** -
 Volatilitet - portfölj 1,7%
 Volatilitet - index 1,8%
 Aktiv risk 0,3%
 Info. Kvot 0,50
 Sharpekvot - portfölj 0,60
 Jensens alfa 0,2%
 Beta 0,95
 Förklaringsgrad 97,3%
 Konsistens 68,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	3 371,7	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	0,0%	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	0,8%	-0,5%	0,1%	-1,2%	3,4%	2,7%	1,8%
Avkastning - index	0,9%	-0,4%	0,2%	-1,2%	2,9%	1,9%	1,5%
Skillnad	-0,2%	-0,1%	-0,1%	0,0%	0,5%	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

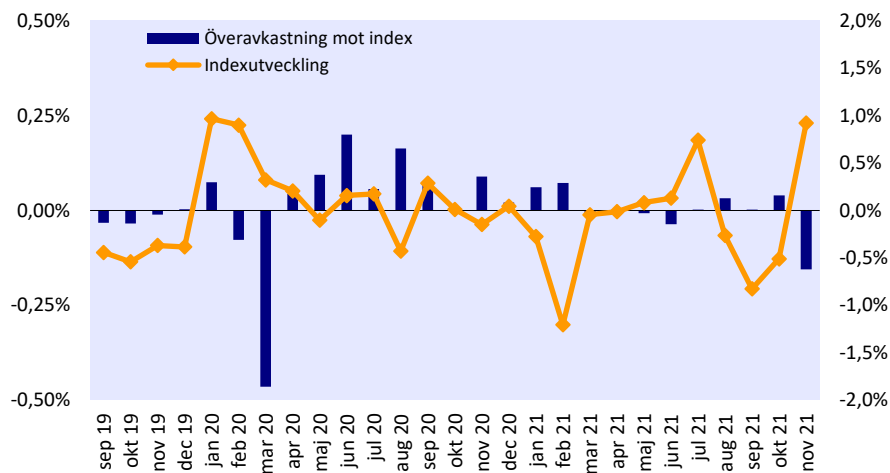
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

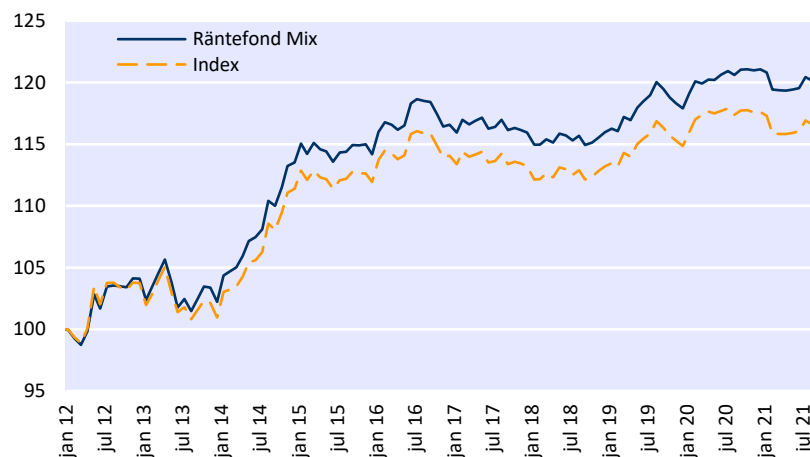
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



Utveckling fond vs index



DEFINITIONER

Avkastning	Avkastningen avser den värdeökning alternativt värdeminskning som uppstått 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 avvikelserna 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.