

# **AMF Fonder AB - Månadsrapport**

## **per 2020-07-31**

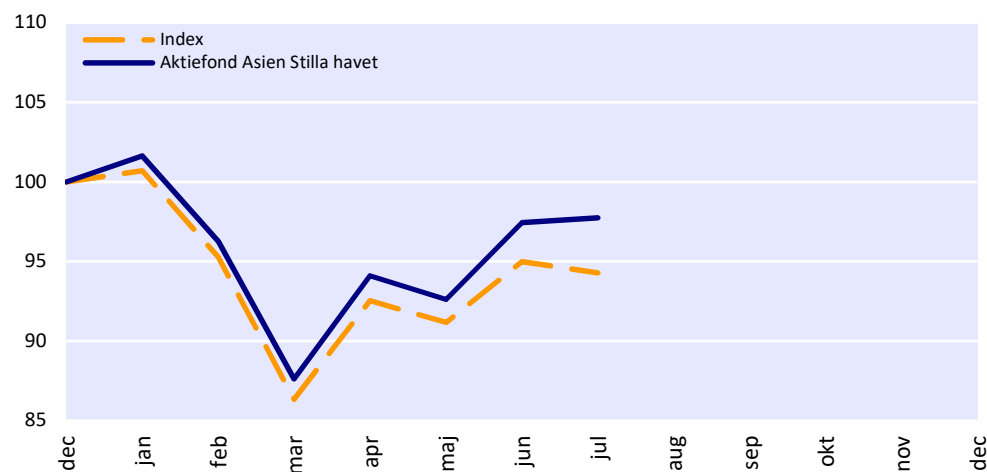


**AMF Fonder AB, 113 88 Stockholm**  
**Besöksadress: Klara Södra Kyrkogata 18**  
Telefon 08-696 31 00  
[www.amf.se](http://www.amf.se)

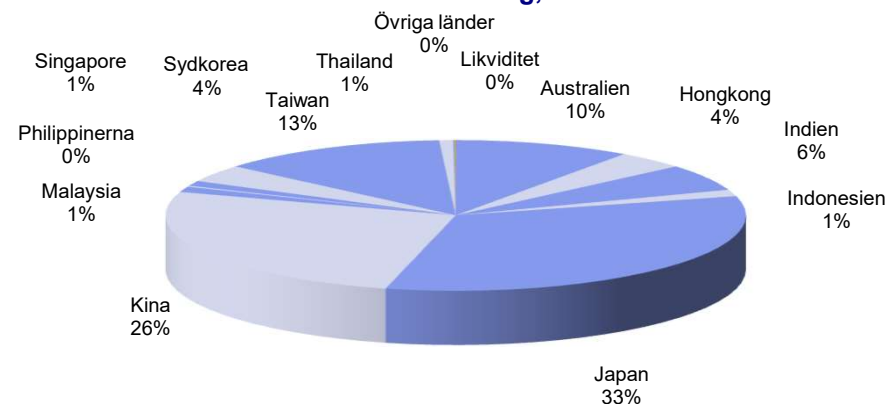
# AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Asien och Stillahavsområdet.

**Utveckling**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond Asien Stilla havet**  
**Länderfördelning, %**



| Aktiefond Asien Stilla havet |           |
|------------------------------|-----------|
| Totalt antal andelar         | 5 787 487 |
| Total förmögenhet MSEK       | 1 355,1   |
| Likviditet *                 | 0,1%      |
| Avkastning från årets början | -2,25%    |
| Avkastning Index             | -5,72%    |
| Nav-kurs                     | 234,14    |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav            | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Alibaba Group Holding, Kina     | 9,6              |
| Tencent Holdings, Kina          | 9,5              |
| Taiwan Semiconductor Manufactur | 8,1              |
| Sony, Japan                     | 4,5              |
| Hong Kong Exchange & Clearing   | 3,0              |

| Största aktieinnehav        | Portföljandel, % |
|-----------------------------|------------------|
| Murata Manufacturing, Japan | 2,9              |
| Keyence, Japan              | 2,8              |
| Goodman Group, Australien   | 2,7              |
| Mediatek, Taiwan            | 1,9              |
| Meituan Dianping, Kina      | 1,9              |

**47,0**

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

# AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

**Perioden 150731-200731 (5 år)\***  
Marknadsvärde (MSEK) 1 355,1

Avkastning - portfölj 44,1%  
Avkastning - index 40,0%  
Skillnad 4,0%

Riskindikator 5  
Hållbarhetsbetyg 5  
Morningstar rating \*\* 5  
Volatilitet - portfölj 13,9%  
Volatilitet - index 13,9%  
Aktiv risk 1,3%  
Info. Kvot 0,49  
Sharpekvot - portfölj 0,59  
Jensens alfa 0,7%  
Beta 0,99  
Förklaringsgrad 99,2%  
Konsistens 61,7%

|                      | 2020    | 2019    | 2018  | 2017  | 2016    | 2015    | 2014    |
|----------------------|---------|---------|-------|-------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 1 355,1 | 1 305,1 | 918,9 | 979,3 | 1 584,8 | 1 319,4 | 1 187,4 |

|                       |       |       |       |       |       |       |       |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Avkastning - portfölj | -2,3% | 28,3% | -5,6% | 17,2% | 11,1% | 6,5%  | 14,7% |
| Avkastning - index    | -5,7% | 28,5% | -6,8% | 17,6% | 13,1% | 8,1%  | 18,9% |
| Skillnad              | 3,5%  | -0,2% | 1,1%  | -0,3% | -2,0% | -1,6% | -4,2% |

|                       | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år  | 5 år  | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | 0,3%  | 3,9%  | -3,8% | 4,8% | 32,2% | 44,1% | 8,4%     |
| Avkastning - index    | -0,7% | 1,9%  | -6,4% | 0,7% | 25,5% | 40,0% | 8,8%     |
| Skillnad              | 1,1%  | 2,0%  | 2,6%  | 4,1% | 6,7%  | 4,0%  | -0,4%    |

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

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

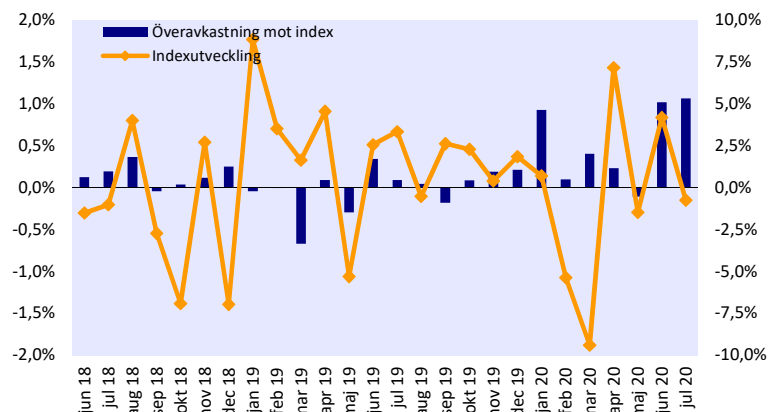
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

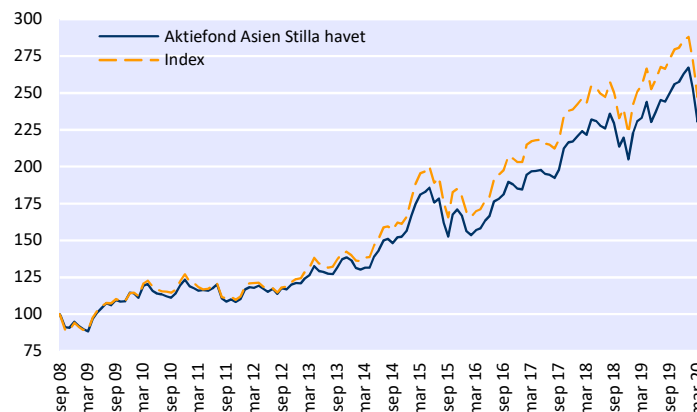
## Överavkastning

## Månatlig överavkastning mot index

## Indexutveckling



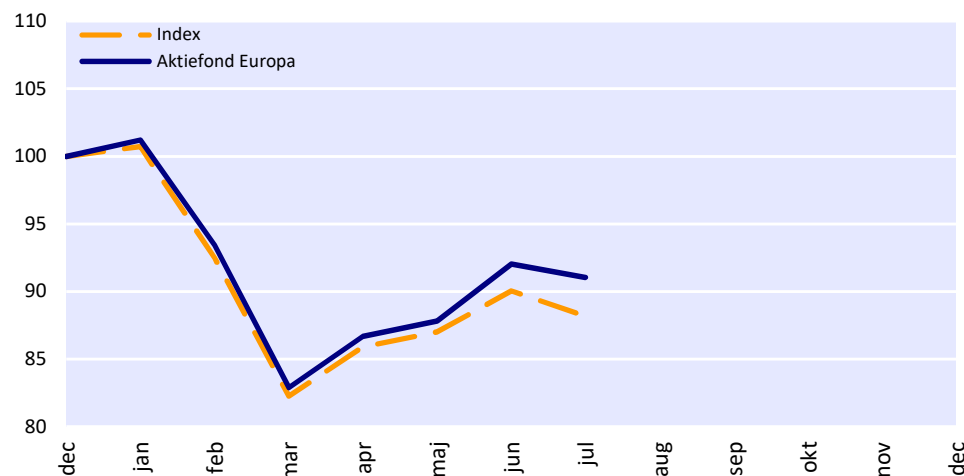
## Utveckling fond vs index



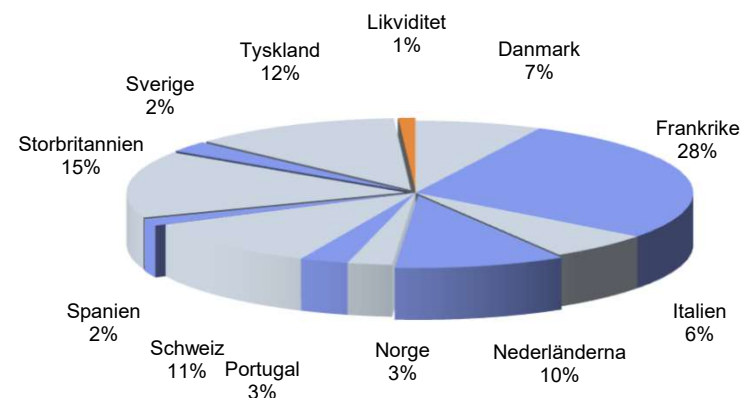
# AMF AKTIEFOND EUROPA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Europa.

**Utveckling**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond Europa**  
Länderfördelning, %



| Aktiefond Europa             |            |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar         | 23 965 106 |
| Total förmögenhet MSEK       | 4 988,6    |
| Likviditet *                 | 1,0%       |
| Avkastning från årets början | -8,97%     |
| Avkastning Index             | -11,82%    |
| Nav-kurs                     | 208,16     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav         | Portföljandel, % |
|------------------------------|------------------|
| Roche, Schweiz               | 6,4              |
| SAP, Tyskland                | 4,7              |
| Saint Gobain, Frankrike      | 3,9              |
| Vestas Wind Systems, Danmark | 3,9              |
| Enel, Italien                | 3,9              |

| Största aktieinnehav            | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Total, Frankrike                | 3,5              |
| Glaxosmithkline, Storbritannien | 3,3              |
| Atos SE, Frankrike              | 3,1              |
| Allianz, Tyskland               | 3,0              |
| Tesco, Storbritannien           | 2,9              |
| <b>Totalt</b>                   | <b>38,5</b>      |

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



# AMF AKTIEFOND EUROPA

| Perioden 150731-200731 (5 år) * |         |
|---------------------------------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK)            | 4 988,6 |
| Avkastning - portfölj           | 16,1%   |
| Avkastning - index              | 15,6%   |
| Skillnad                        | 0,5%    |
| Riskindikator                   | 6       |
| Hållbarhetsbetyg                | 4       |
| Morningstar rating **           | 5       |
| Volatilitet - portfölj          | 14,5%   |
| Volatilitet - index             | 14,2%   |
| Aktiv risk                      | 2,2%    |
| Info. kvot                      | 0,04    |
| Sharpekvot - portfölj           | 0,25    |
| Jensens alfa                    | 0,0%    |
| Beta                            | 1,01    |
| Förklaringsgrad                 | 97,6%   |
| Konsistens                      | 60,0%   |

|                       | 2020    | 2019    | 2018    | 2017    | 2016    | 2015    | 2014    |
|-----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK)  | 4 988,6 | 5 611,9 | 4 362,4 | 5 558,7 | 4 162,5 | 4 157,7 | 3 449,1 |
| Avkastning - portfölj | -9,0%   | 29,6%   | -8,9%   | 12,1%   | 7,0%    | 6,4%    | 15,5%   |
| Avkastning - index    | -11,8%  | 32,5%   | -6,2%   | 11,8%   | 5,6%    | 4,7%    | 14,4%   |
| Skillnad              | 2,8%    | -2,8%   | -2,7%   | 0,3%    | 1,4%    | 1,8%    | 1,1%    |

|                       | 1 mån | 3 mån | 6 mån  | 1 år  | 3 år  | 5 år  | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | -1,1% | 5,0%  | -10,1% | -3,6% | 11,4% | 16,1% | 5,4%     |
| Avkastning - index    | -2,1% | 2,7%  | -12,5% | -4,3% | 15,9% | 15,6% | 3,9%     |
| Skillnad              | 1,0%  | 2,4%  | 2,4%   | 0,7%  | -4,5% | 0,5%  | 1,5%     |

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

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

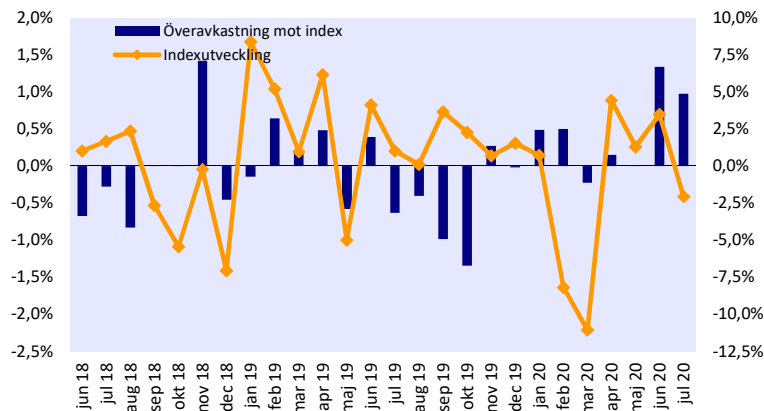
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

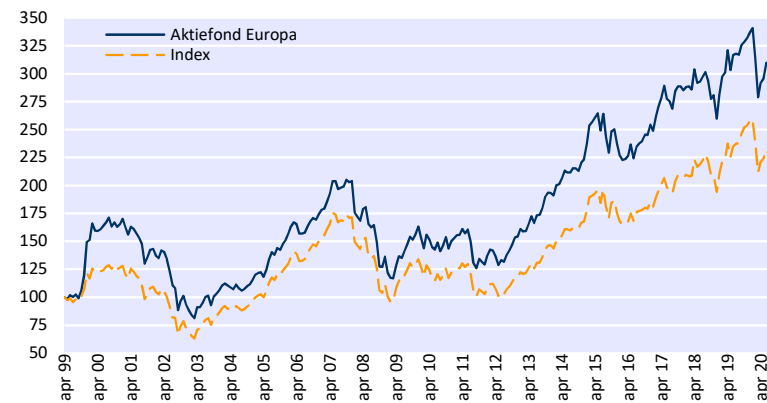
## Överavkastning

## Månatlig överavkastning mot index

## Indexutveckling



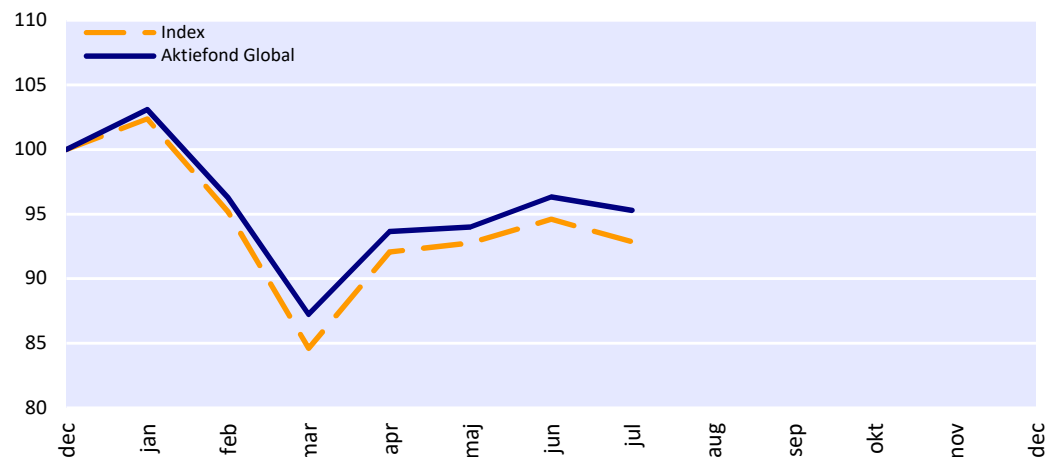
## Utveckling fond vs index



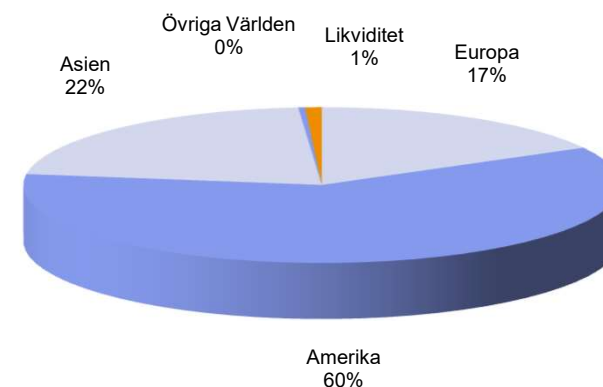
# AMF AKTIEFOND GLOBAL

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**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond Global**  
Länderfördelning, %



| Aktiefond Global             |            |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar         | 86 017 768 |
| Total förmögenhet MSEK       | 17 173,2   |
| Likviditet *                 | 199,7%     |
| Avkastning från årets början | -4,72%     |
| Avkastning Index             | -7,14%     |
| Nav-kurs                     | 201,82     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

| Största aktieinnehav           | Portföljandel, % |
|--------------------------------|------------------|
| Microsoft, USA                 | 5,9              |
| Alphabet, USA                  | 3,7              |
| Alibaba Group Holding, Kina    | 2,9              |
| Taiwan Semiconductor Manufactu | 2,2              |
| Procter & Gamble, USA          | 2,1              |

| Största aktieinnehav   | Portföljandel, % |
|------------------------|------------------|
| Tencent Holdings, Kina | 1,7              |
| Pepsico, USA           | 1,7              |
| Coca-Cola, USA         | 1,7              |
| Home Depot, USA        | 1,6              |
| Visa, USA              | 1,5              |
|                        | 25,0             |

# AMF AKTIEFOND GLOBAL

**Perioden 150731-200731 (5 år) \***

Marknadsvärde (MSEK) 17 173,2

Avkastning - portfölj 51,2%

Avkastning - index 47,8%

Skillnad 3,4%

Riskindikator 5

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating \*\* 5

Volatilitet - portfölj 13,6%

Volatilitet - index 14,3%

Aktiv risk 1,4%

Info. kvot 0,34

Sharpekvot - portfölj 0,68

Jensens alfa 1,0%

Beta 0,94

Förklaringsgrad 99,1%

Konsistens 55,0%

|                      | 2020     | 2019     | 2018    | 2017    | 2016    | 2015    | 2014    |
|----------------------|----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 17 173,2 | 17 424,4 | 3 657,2 | 3 522,8 | 3 188,1 | 2 507,6 | 2 223,9 |

|                       |       |       |       |       |       |      |       |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|
| Avkastning - portfölj | -4,7% | 34,7% | -1,1% | 10,1% | 15,6% | 6,7% | 25,4% |
| Avkastning - index    | -7,1% | 34,3% | -1,1% | 10,9% | 16,2% | 5,6% | 27,0% |
| Skillnad              | 2,4%  | 0,4%  | 0,0%  | -0,8% | -0,6% | 1,1% | -1,7% |

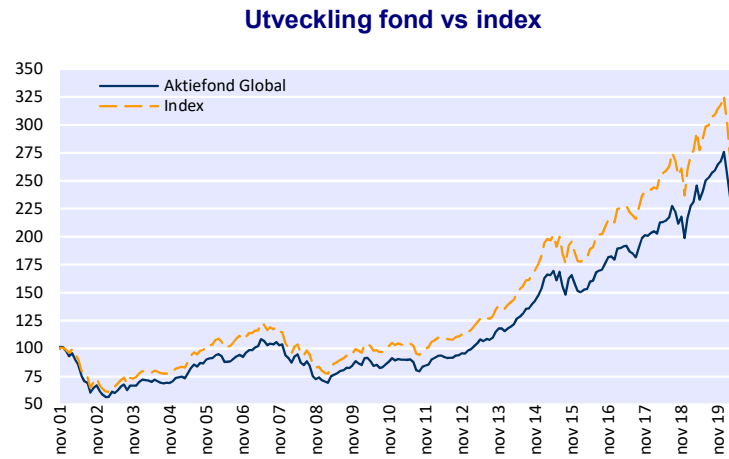
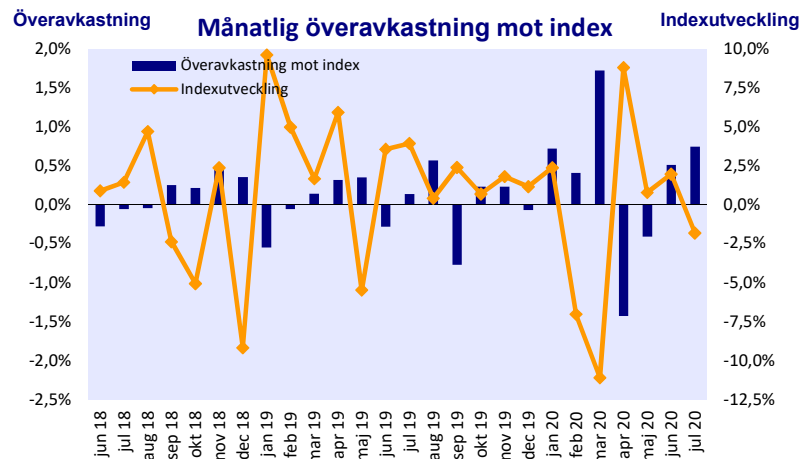
|                       | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år  | 3 år  | 5 år  | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | -1,1% | 1,7%  | -7,6% | 1,7%  | 37,9% | 51,2% | 5,2%     |
| Avkastning - index    | -1,8% | 0,9%  | -9,3% | -1,0% | 34,8% | 47,8% | 6,0%     |
| Skillnad              | 0,7%  | 0,9%  | 1,7%  | 2,8%  | 3,1%  | 3,4%  | -0,8%    |

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

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

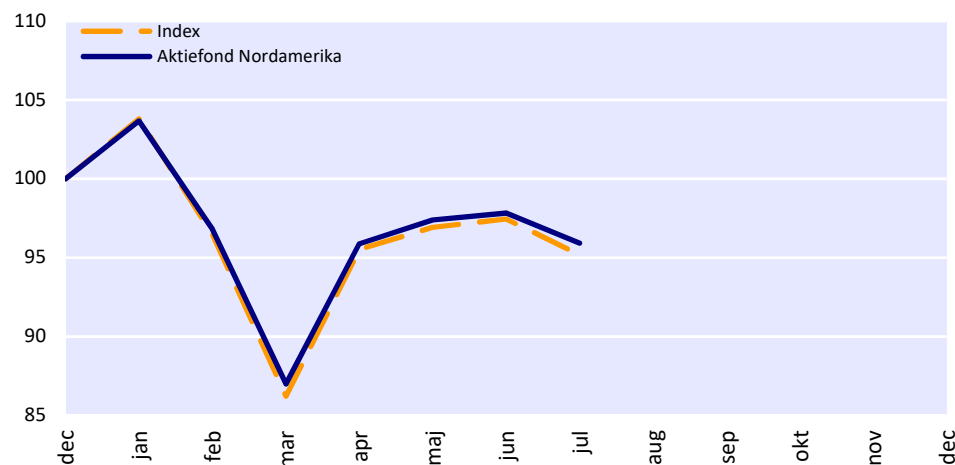
\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



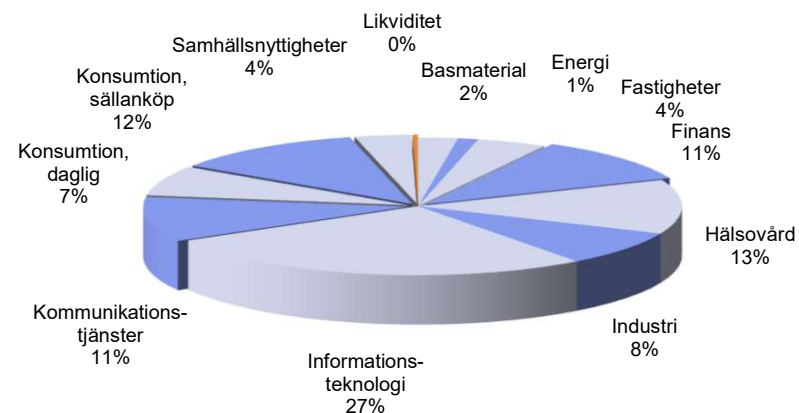
# AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

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

**Utveckling**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond Nordamerika**  
branschfördelning, %



| Aktiefond Nordamerika        |           |
|------------------------------|-----------|
| Totalt antal andelar         | 8 631 978 |
| Total förmögenhet MSEK       | 2 590,8   |
| Likviditet *                 | -0,3%     |
| Avkastning från årets början | -4,07%    |
| Avkastning Index             | -4,82%    |
| Nav-kurs                     | 300,14    |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Microsoft            | 9,9              |
| Alphabet             | 6,4              |
| Visa                 | 3,2              |
| Procter & Gamble     | 3,0              |
| Nvidia               | 2,8              |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Home Depot           | 2,6              |
| Merck & Co           | 2,6              |
| Mastercard A         | 2,6              |
| Salesforce           | 2,4              |
| Bristol-Myers Squibb | 2,1              |
|                      | 37,7             |

# AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

## Perioden 150731-200731 (5 år) \*

Marknadsvärde (MSEK) 2 590,8

Avkastning - portfölj 72,0%

Avkastning - index 69,5%

Skillnad 2,5%

Riskindikator 6

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating \*\* 3

Volatilitet - portfölj 14,9%

Volatilitet - index 15,3%

Aktiv risk 1,1%

Info. Kvot 0,28

Sharpekvot - portfölj 0,81

Jensens alfa 0,7%

Beta 0,97

Förklaringsgrad 99,5%

Konsistens 53,3%

|                      | 2020    | 2019    | 2018    | 2017    | 2016    | 2015    | 2014    |
|----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 2 590,8 | 2 826,5 | 1 808,6 | 1 528,3 | 1 751,1 | 1 267,5 | 1 362,0 |

Avkastning - portfölj -4,1% 39,0% 5,3% 6,9% 18,7% 10,1% 35,8%

Avkastning - index -4,8% 38,2% 4,3% 8,0% 19,6% 8,1% 37,2%

Skillnad 0,7% 0,7% 1,0% -1,1% -0,9% 2,0% -1,5%

|                       | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år  | 5 år  | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | -2,0% | 0,0%  | -7,5% | 2,5% | 53,8% | 72,0% | 9,8%     |
| Avkastning - index    | -2,3% | -0,4% | -8,3% | 1,3% | 50,5% | 69,5% | 10,8%    |
| Skillnad              | 0,4%  | 0,4%  | 0,8%  | 1,2% | 3,3%  | 2,5%  | -1,0%    |

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

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

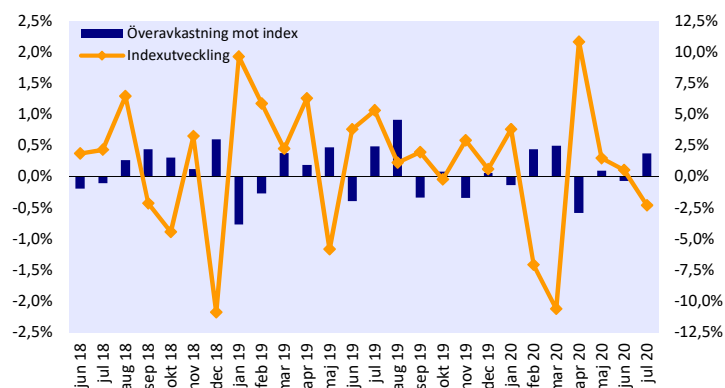
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

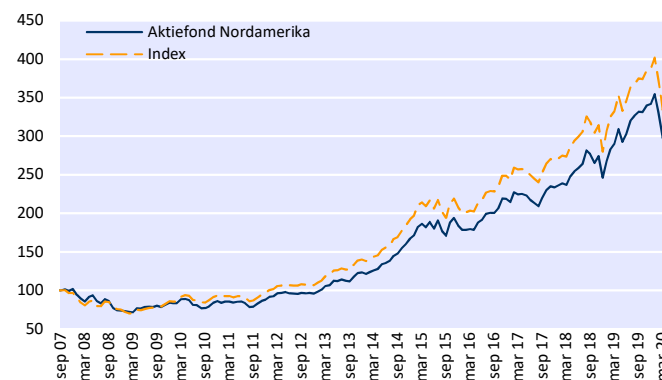
## Överavkastning

## Månatlig överavkastning mot index

## Indexutveckling



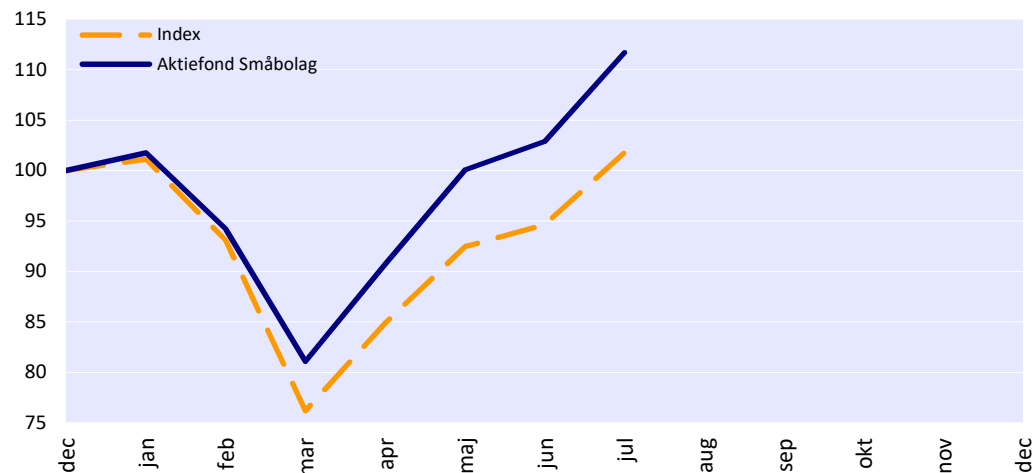
## Utveckling fond vs index



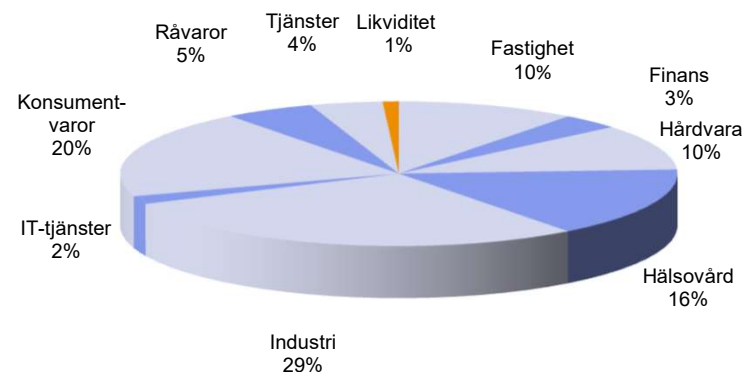
# AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

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**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond Småbolag**  
Branschfördelning, %



| Aktiefond Småbolag           |            |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar         | 12 250 360 |
| Total förmögenhet MSEK       | 11 305,3   |
| Likviditet *                 | 0,9%       |
| Avkastning från årets början | 11,69%     |
| Avkastning index             | 1,79%      |
| Nav-kurs                     | 922,85     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Sinch                | 4,6              |
| Sweco                | 3,5              |
| Beijer Ref           | 3,5              |
| Nibe                 | 3,4              |
| Indutrade            | 3,1              |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Bure                 | 2,8              |
| Getinge              | 2,5              |
| Trelleborg           | 2,5              |
| Castellum            | 2,4              |
| Avanza               | 2,4              |
|                      | <b>30,8</b>      |

# AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

**Perioden 150731-200731 (5 år) \***

Marknadsvärde (MSEK) 11 305,3

Avkastning - portfölj 111,7%

Avkastning - index 93,5%

*Skillnad* 18,1%

Riskindikator 6

Hållbarhetsbetyg 4

Morningstar rating \*\* 3

Volatilitet - portfölj 16,7%

Volatilitet - index 17,2%

Aktiv risk 2,9%

Info. kvot 0,71

Sharpekvot - portfölj 1,00

Jensens alfa 2,5%

Beta 0,97

Förklaringsgrad 97,0%

Konsistens 60,0%

|                      | 2020     | 2019    | 2018    | 2017    | 2016    | 2015    | 2014    |
|----------------------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 11 305,3 | 9 803,5 | 6 723,3 | 7 358,6 | 6 492,9 | 5 666,5 | 3 816,1 |

|                       |       |       |       |      |       |       |       |
|-----------------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|
| Avkastning - portfölj | 11,7% | 42,2% | -2,6% | 9,6% | 13,0% | 34,2% | 12,0% |
|-----------------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|-------|

|                    |      |       |       |      |       |       |       |
|--------------------|------|-------|-------|------|-------|-------|-------|
| Avkastning - index | 1,8% | 43,2% | -0,2% | 8,8% | 12,2% | 30,1% | 21,6% |
|--------------------|------|-------|-------|------|-------|-------|-------|

|                 |      |       |       |      |      |      |       |
|-----------------|------|-------|-------|------|------|------|-------|
| <i>Skillnad</i> | 9,9% | -1,0% | -2,4% | 0,8% | 0,9% | 4,2% | -9,5% |
|-----------------|------|-------|-------|------|------|------|-------|

|  | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|--|-------|-------|-------|------|------|------|----------|
|--|-------|-------|-------|------|------|------|----------|

|                       |      |       |      |       |       |        |       |
|-----------------------|------|-------|------|-------|-------|--------|-------|
| Avkastning - portfölj | 8,6% | 23,1% | 9,8% | 24,9% | 55,0% | 111,7% | 16,2% |
|-----------------------|------|-------|------|-------|-------|--------|-------|

|                    |      |       |      |       |       |       |       |
|--------------------|------|-------|------|-------|-------|-------|-------|
| Avkastning - index | 7,6% | 19,9% | 0,7% | 14,7% | 46,7% | 93,5% | 15,6% |
|--------------------|------|-------|------|-------|-------|-------|-------|

|                 |      |      |      |       |      |       |      |
|-----------------|------|------|------|-------|------|-------|------|
| <i>Skillnad</i> | 1,0% | 3,2% | 9,1% | 10,2% | 8,2% | 18,1% | 0,6% |
|-----------------|------|------|------|-------|------|-------|------|

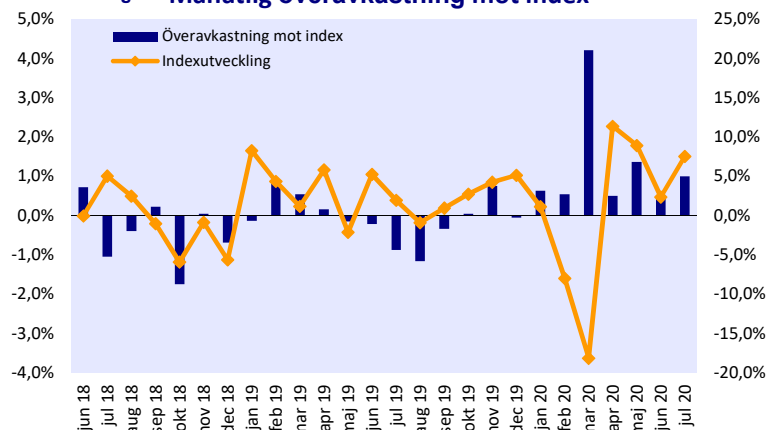
Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

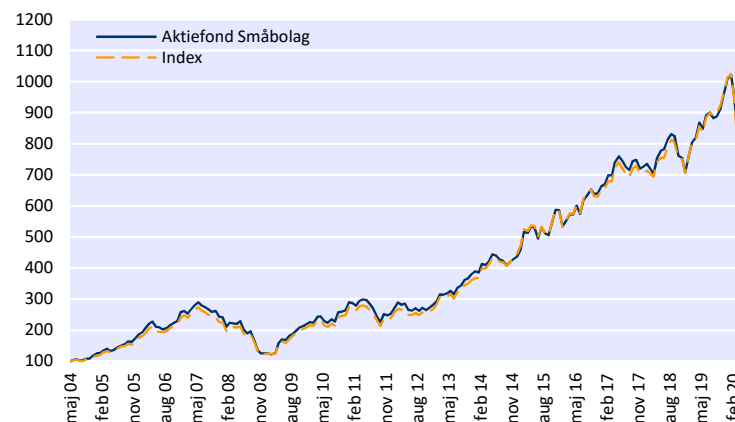
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

## Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



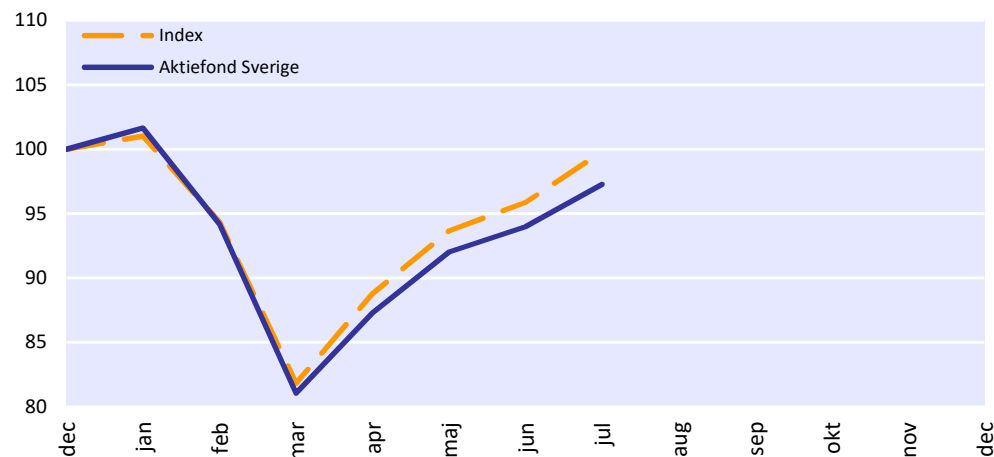
## Utveckling fond vs index



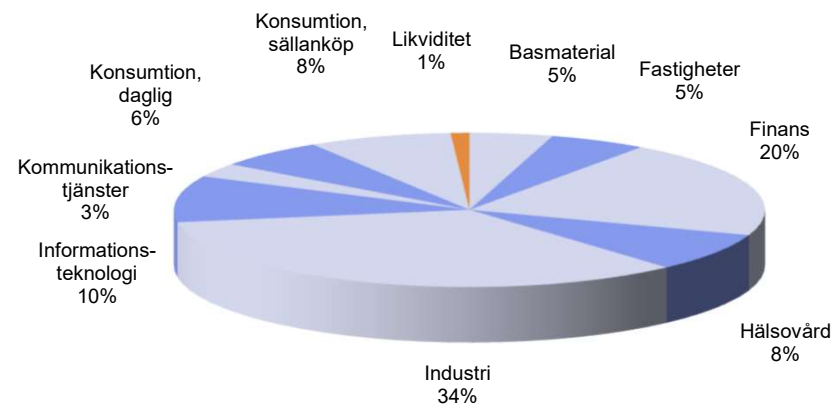
# AMF AKTIEFOND SVERIGE

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

**Utveckling**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond Sverige**  
Branschfördelning, %



| Aktiefond Sverige            |            |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar         | 50 774 743 |
| Total förmögenhet MSEK       | 32 476,3   |
| Likviditet *                 | 1,0%       |
| Avkastning från årets början | -2,74%     |
| Avkastning Index             | -0,20%     |
| Nav-kurs                     | 639,62     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: SIXPRX

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Investor             | 7,3              |
| Atlas Copco          | 6,3              |
| Volvo                | 4,5              |
| Ericsson             | 3,7              |
| SEB                  | 3,6              |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Essity               | 3,4              |
| Hennes & Mauritz     | 3,2              |
| Hexagon              | 3,2              |
| Sandvik              | 2,8              |
| Epiroc               | 2,7              |
|                      | <b>40,6</b>      |



# AMF AKTIEFOND SVERIGE

| Perioden 150731-200731 (5 år) * |          |
|---------------------------------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK)            | 32 476,3 |
| Avkastning - portfölj           | 29,8%    |
| Avkastning - index              | 43,4%    |
| <i>Skillnad</i>                 | -13,6%   |

|                        |       |
|------------------------|-------|
| Riskindikator          | 6     |
| Hållbarhetsbetyg       | 5     |
| Morningstar rating **  | 2     |
| Volatilitet - portfölj | 15,1% |
| Volatilitet - index    | 15,0% |
| Aktiv risk             | 1,8%  |
| Info. kvot             | -1,17 |
| Sharpekvot - portfölj  | 0,40  |
| Jensens alfa           | -2,1% |
| Beta                   | 1,00  |
| Förklaringsgrad        | 98,5% |
| Konsistens             | 31,7% |

|                       | 2020     | 2019     | 2018     | 2017     | 2016     | 2015     | 2014     |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK)  | 32 476,3 | 33 846,3 | 25 371,6 | 27 691,6 | 27 500,3 | 26 529,6 | 25 074,6 |
| Avkastning - portfölj | -2,7%    | 25,7%    | -4,9%    | 7,9%     | 8,6%     | 8,6%     | 15,4%    |
| Avkastning - index    | -0,2%    | 35,0%    | -4,6%    | 10,0%    | 9,2%     | 6,3%     | 15,0%    |
| <i>Skillnad</i>       | -2,5%    | -9,3%    | -0,2%    | -2,2%    | -0,5%    | 2,4%     | 0,3%     |

|                       | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år  | 3 år   | 5 år   | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|----------|
| Avkastning - portfölj | 3,5%  | 11,4% | -4,3% | 4,7%  | 18,9%  | 29,8%  | 11,2%    |
| Avkastning - index    | 4,1%  | 12,4% | -1,2% | 11,4% | 31,9%  | 43,4%  | 9,5%     |
| <i>Skillnad</i>       | -0,6% | -1,0% | -3,1% | -6,7% | -13,0% | -13,6% | 1,7%     |

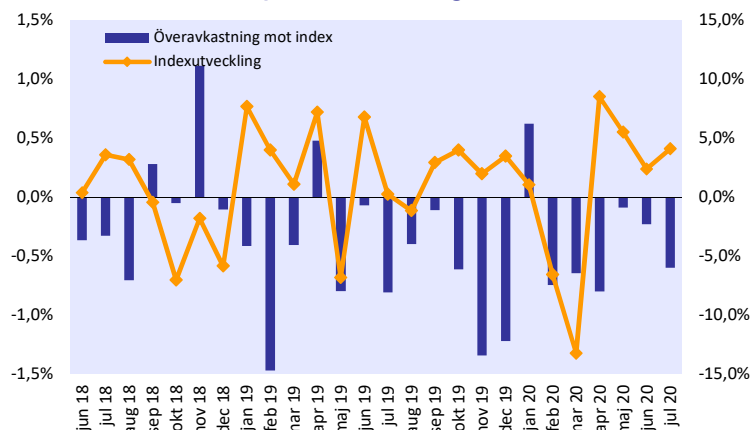
Referensindex: SIXPRX

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

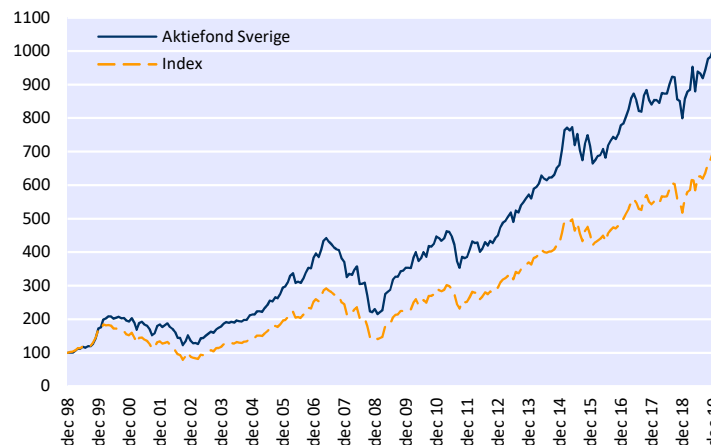
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

## Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



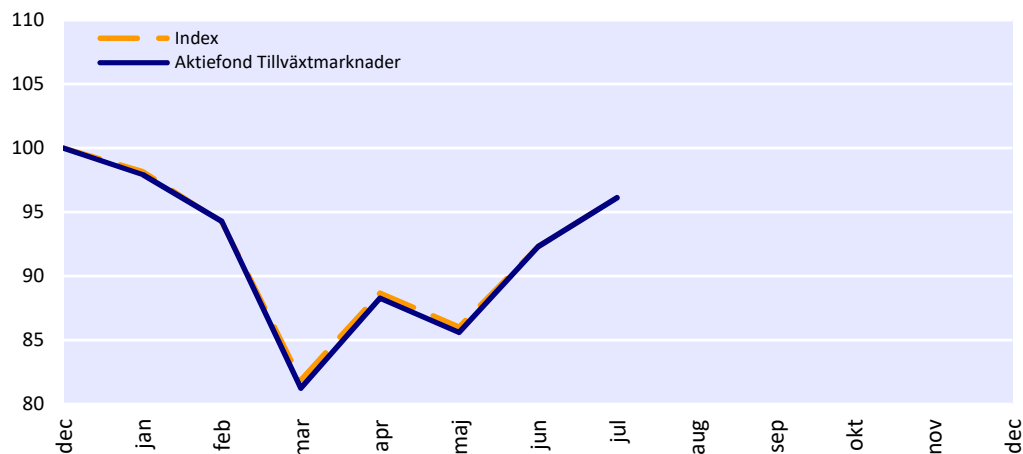
## Utveckling fond vs index



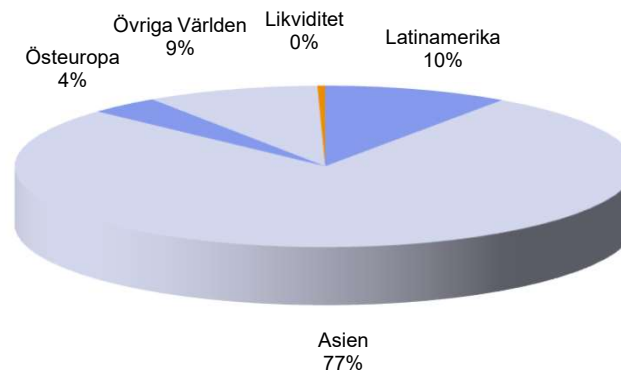
# AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

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

**Utveckling**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond  
Tillväxtmarknader**  
Regionfördelning, %



| Aktiefond Tillväxtmarknader  |            |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar         | 13 647 119 |
| Total förmögenhet MSEK       | 1 369,4    |
| Likviditet *                 | 0,4%       |
| Avkastning från årets början | -3,87%     |
| Avkastning Index             | -3,88%     |
| Nav-kurs                     | 100,34     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav         | Portföljandel, % |
|------------------------------|------------------|
| Alibaba Group Holding, Kina  | 9,7              |
| Tencent Holdings, Kina       | 9,6              |
| Taiwan Semiconductor Manufac | 9,4              |
| Reliance Industries, Indien  | 4,3              |
| Mediatek, Taiwan             | 2,9              |

| Största aktieinnehav          | Portföljandel, % |
|-------------------------------|------------------|
| Meituan Dianping, Kina        | 2,8              |
| Naspers, Sydafrika            | 2,6              |
| Pinduoduo, Kina               | 2,4              |
| Wuxi Biologics, Kina          | 2,1              |
| China Construction Bank, Kina | 1,9              |
|                               | <b>47,8</b>      |

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

# AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

## Perioden 191211-200731 <sup>1),2)</sup>

Marknadsvärde (MSEK) 1 369,4

Avkastning - portfölj 0,3%

Avkastning - index 0,4%

Skillnad -0,1%

Riskindikator 6

Hållbarhetsbetyg 4

Morningstar rating -

Volatilitet - portfölj <sup>3)</sup> 16,0%

Volatilitet - index <sup>3)</sup> 15,8%

Aktiv risk <sup>2)</sup> -

Info. Kvot <sup>2)</sup> -

Sharpekvot - portfölj <sup>2)</sup> -

Jensens alfa <sup>2)</sup> -

Beta <sup>2)</sup> -

Förklaringsgrad <sup>2)</sup> -

Konsistens <sup>2)</sup> 50,0%

## 2020 2019

Marknadsvärde (MSEK) 1 369,4 322,2

Avkastning - portfölj -3,9% 4,4%

Avkastning - index -3,9% 4,5%

Skillnad 0,0% -0,1%

## 1 mån 3 mån 6 mån Start

Avkastning - portfölj 4,2% 8,9% -1,8% 0,3%

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

Skillnad 0,0% 0,5% 0,2% -0,1%

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

<sup>1)</sup> Alla värden beräknas inkl avgifter

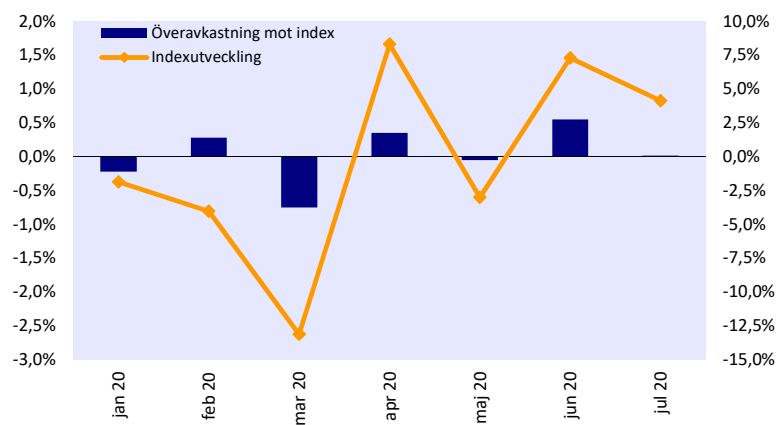
<sup>2)</sup> Från fondens start

<sup>3)</sup> Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

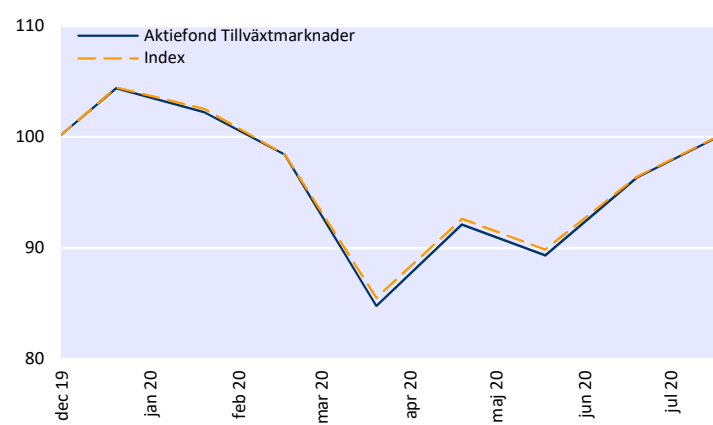
## Överavkastning

## Månatlig överavkastning mot index

## Indexutveckling



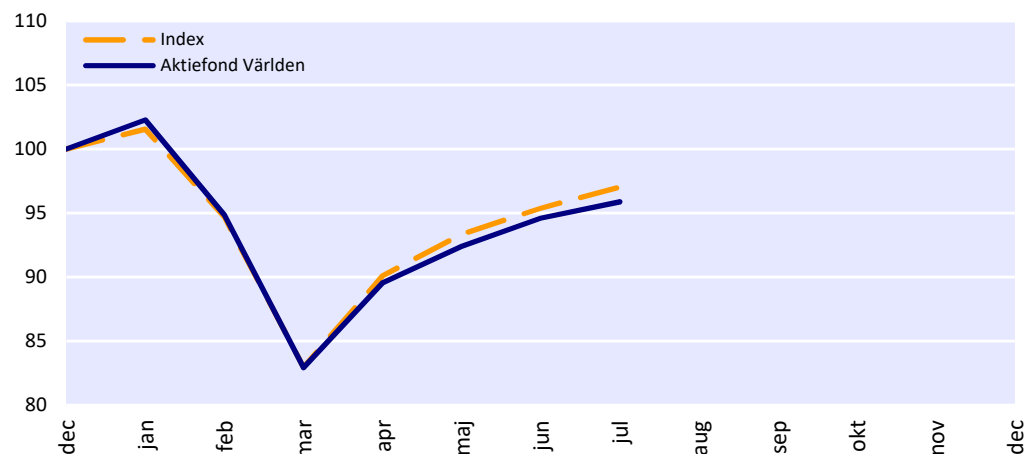
## Utveckling fond vs index



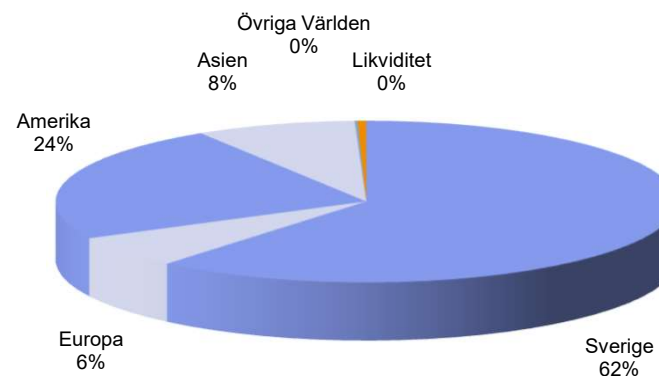
# AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

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**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Aktiefond Världen**  
Regionfördelning, %



| Aktiefond Världen            |            |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar         | 85 422 633 |
| Total förmögenhet MSEK       | 36 680,9   |
| Likviditet *                 | -0,5%      |
| Avkastning från årets början | -4,13%     |
| Avkastning Index             | -2,96%     |
| Nav-kurs                     | 429,40     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Investor             | 5,0              |
| Atlas Copco          | 3,4              |
| Volvo                | 2,8              |
| Microsoft, USA       | 2,6              |
| SEB                  | 2,2              |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Ericsson             | 2,2              |
| Essity               | 2,1              |
| Hennes & Mauritz     | 2,0              |
| Hexagon              | 1,9              |
| Sandvik              | 1,7              |
|                      | <b>25,9</b>      |

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

# AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

| Perioden 150731-200731 (5 år) * |          |
|---------------------------------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK)            | 36 680,9 |

|                       |       |
|-----------------------|-------|
| Avkastning - portfölj | 36,8% |
| Avkastning - index    | 45,6% |
| <i>Skillnad</i>       | -8,8% |

|                        |       |
|------------------------|-------|
| Riskindikator          | 6     |
| Hållbarhetsbetyg       | 5     |
| Morningstar rating **  | 3     |
| Volatilitet - portfölj | 14,1% |
| Volatilitet - index    | 14,2% |
| Aktiv risk             | 1,6%  |
| Info. kvot             | -0,85 |
| Sharpekvot - portfölj  | 0,50  |
| Jensens alfa           | -1,2% |
| Beta                   | 0,99  |
| Förklaringsgrad        | 98,7% |
| Konsistens             | 38,3% |

|                      | 2020     | 2019     | 2018     | 2017     | 2016     | 2015     | 2014     |
|----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 36 680,9 | 39 160,8 | 31 486,5 | 33 731,8 | 32 024,0 | 29 410,8 | 27 898,8 |

|                       |       |       |       |       |       |      |       |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|------|-------|
| Avkastning - portfölj | -4,1% | 28,3% | -3,7% | 8,1%  | 11,6% | 8,7% | 19,9% |
| Avkastning - index    | -3,0% | 34,8% | -3,2% | 10,5% | 12,0% | 6,0% | 19,8% |
| <i>Skillnad</i>       | -1,2% | -6,5% | -0,5% | -2,4% | -0,4% | 2,7% | 0,1%  |

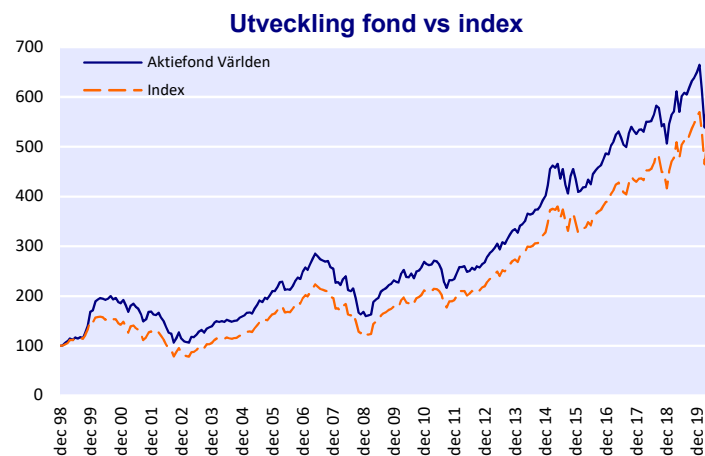
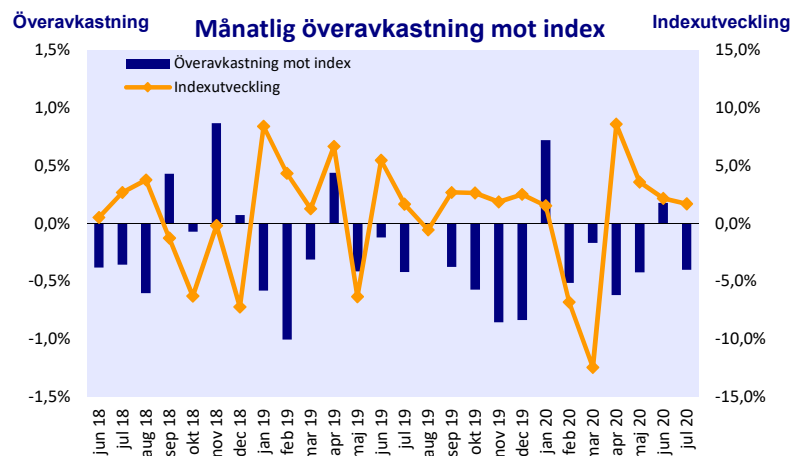
|                       | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år  | 3 år  | 5 år  | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | 1,3%  | 7,0%  | -6,3% | 2,4%  | 23,7% | 36,8% | 8,9%     |
| Avkastning - index    | 1,7%  | 7,7%  | -4,4% | 6,3%  | 33,4% | 45,6% | 8,2%     |
| <i>Skillnad</i>       | -0,4% | -0,7% | -1,8% | -4,0% | -9,7% | -8,8% | 0,7%     |

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

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

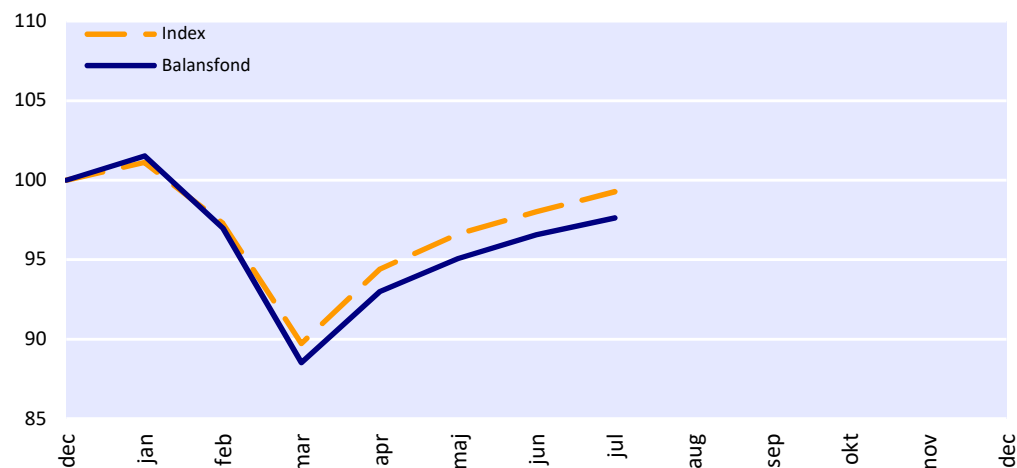
\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



# 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**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Balansfond**  
fördelning aktier/räntebärande, %



| Balansfond                   |            |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar         | 73 061 746 |
| Total förmögenhet MSEK       | 22 052,6   |
| Likviditet *                 | 0,0%       |
| Modifierad duration          | 4,02%      |
| Avkastning från årets början | -2,37%     |
| Avkastning Index             | -0,72%     |
| Nav-kurs                     | 301,83     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Investor             | 3,3              |
| Atlas Copco          | 2,5              |
| Volvo                | 1,9              |
| SEB                  | 1,5              |
| Ericsson             | 1,5              |
|                      | <b>10,7</b>      |

| Största ränteb. Emittent | Portföljandel, % |
|--------------------------|------------------|
| Stat Sverige             | 7,1              |
| SEB Bolån                | 4,5              |
| SBAB                     | 3,3              |
| Scania                   | 2,1              |
| Swedbank Hypotek         | 1,8              |
|                          | <b>18,7</b>      |

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

# AMF BALANSFOND

| Perioden 150731-200731 (5 år) * |          |
|---------------------------------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK)            | 22 052,6 |

|                       |       |
|-----------------------|-------|
| Avkastning - portfölj | 23,5% |
| Avkastning - index    | 29,7% |
| Skillnad              | -6,2% |

|                        |       |
|------------------------|-------|
| Riskindikator          | 4     |
| Hållbarhetsbetyg       | -     |
| Morningstar rating **  | 4     |
| Volatilitet - portfölj | 8,9%  |
| Volatilitet - index    | 8,6%  |
| Aktiv risk             | 1,1%  |
| Info. kvot             | -0,98 |
| Sharpekvot - portfölj  | 0,56  |
| Jensens alfa           | -1,2% |
| Beta                   | 1,02  |
| Förklaringsgrad        | 98,5% |
| Konsistens             | 35,0% |

|                       | 2020     | 2019     | 2018     | 2017     | 2016     | 2015     | 2014     |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK)  | 22 052,6 | 23 265,8 | 20 513,5 | 21 734,7 | 21 288,0 | 20 303,8 | 19 884,5 |
| Avkastning - portfölj | -2,4%    | 16,9%    | -1,9%    | 5,2%     | 8,3%     | 5,6%     | 14,7%    |
| Avkastning - index    | -0,7%    | 20,5%    | -1,5%    | 6,4%     | 8,1%     | 4,1%     | 14,3%    |
| Skillnad              | -1,7%    | -3,7%    | -0,5%    | -1,2%    | 0,1%     | 1,4%     | 0,4%     |

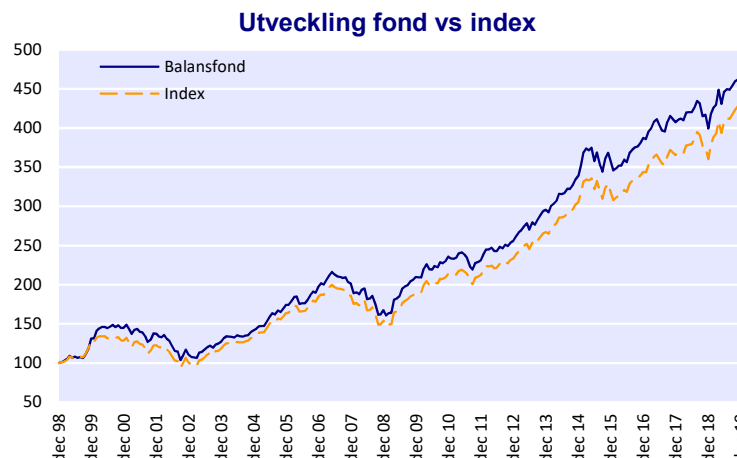
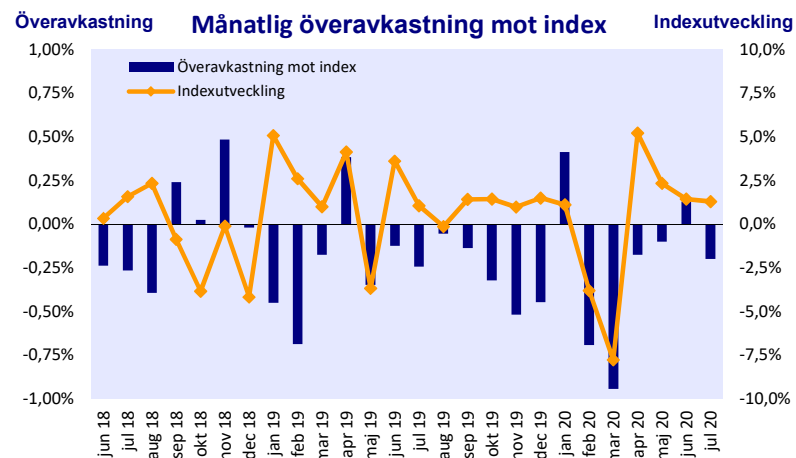
|                       | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år  | 3 år  | 5 år  | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | 1,1%  | 5,0%  | -3,8% | 1,3%  | 14,9% | 23,5% | 7,3%     |
| Avkastning - index    | 1,3%  | 5,2%  | -1,8% | 4,6%  | 21,6% | 29,7% | 7,0%     |
| Skillnad              | -0,2% | -0,2% | -2,0% | -3,2% | -6,7% | -6,2% | 0,3%     |

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds 40%, SIXRX 40%, MSCI ACWI ESG Leaders NR (omräkn Sek) 201

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

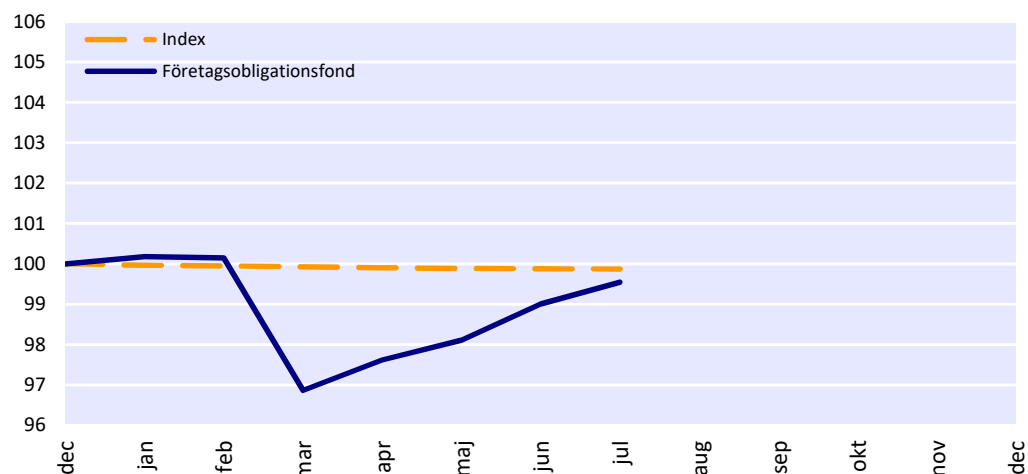
\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



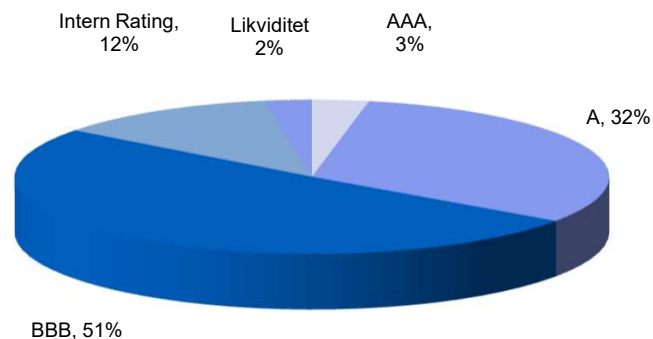
# AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

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**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Företagsobligationsfond**  
Rating, %



| Företagsobligationsfond               |           |
|---------------------------------------|-----------|
| Totalt antal andelar                  | 6 748 281 |
| Total förmögenhet MSEK                | 676,6     |
| Likviditet *                          | 2,6%      |
| Duration                              | 0,36      |
| Modifierad duration                   | 0,36%     |
| Modifierad duration krediter          | 0,36%     |
| Yield                                 | 1,18%     |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 2,35      |
| Avkastning från årets början          | -0,46%    |
| Avkastning index                      | -0,13%    |
| Nav-kurs                              | 100,27    |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

**Referensindex:** Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

| Största räntebärande emittenter    | Portföljandel, % |
|------------------------------------|------------------|
| SBAB Bank                          | 7,8              |
| Hexagon                            | 7,7              |
| Bank of Novia Scotia               | 5,9              |
| Canadien Imperial bank of Commerce | 5,9              |
| Santander Consumer Bank            | 5,8              |
|                                    | <b>33,2</b>      |



# AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

| Perioden 180829-200731 <sup>1),2)</sup> |       |
|-----------------------------------------|-------|
| Marknadsvärde (MSEK)                    | 676,6 |

|                       |        |
|-----------------------|--------|
| Avkastning - portfölj | 0,27%  |
| Avkastning - index    | -0,95% |
| <i>Skillnad</i>       | 1,22%  |

|                                      |       |
|--------------------------------------|-------|
| Riskindikator <sup>3)</sup>          | 1     |
| Hållbarhetsbetyg                     | 5     |
| Morningstar rating                   | -     |
| Volatilitet - portfölj <sup>3)</sup> | 1,7%  |
| Volatilitet - index <sup>3)</sup>    | 0,1%  |
| Aktiv risk <sup>2)</sup>             | -     |
| Info. Kvot <sup>2)</sup>             | -     |
| Sharpekvot - portfölj <sup>2)</sup>  | -     |
| Jensens alfa <sup>2)</sup>           | -     |
| Beta <sup>2)</sup>                   | -     |
| Förklaringsgrad <sup>2)</sup>        | -     |
| Konsistens <sup>2)</sup>             | 77,3% |

|                      | 2020  | 2019  | 2018  |
|----------------------|-------|-------|-------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 676,6 | 641,8 | 536,5 |

|                       |        |        |        |
|-----------------------|--------|--------|--------|
| Avkastning - portfölj | -0,46% | 1,60%  | -0,86% |
| Avkastning - index    | -0,13% | -0,53% | -0,30% |
| <i>Skillnad</i>       | -0,33% | 2,13%  | -0,56% |

|                       | 1 mån  | 3 mån  | 6 mån  | 1 år   | Start <sup>4)</sup> |
|-----------------------|--------|--------|--------|--------|---------------------|
| Avkastning - portfölj | 0,54%  | 1,97%  | -0,63% | -0,10% | 0,15%               |
| Avkastning - index    | -0,01% | -0,03% | -0,09% | -0,36% | -0,52%              |
| <i>Skillnad</i>       | 0,55%  | 2,01%  | -0,54% | 0,26%  | 0,67%               |

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

<sup>1)</sup> Alla värden beräknas inkl avgifter

<sup>2)</sup> Från fondens start

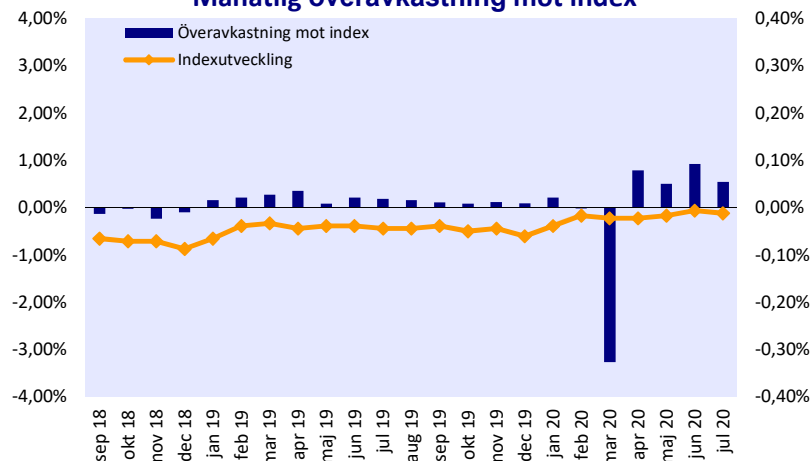
<sup>3)</sup> Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

<sup>4)</sup> Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

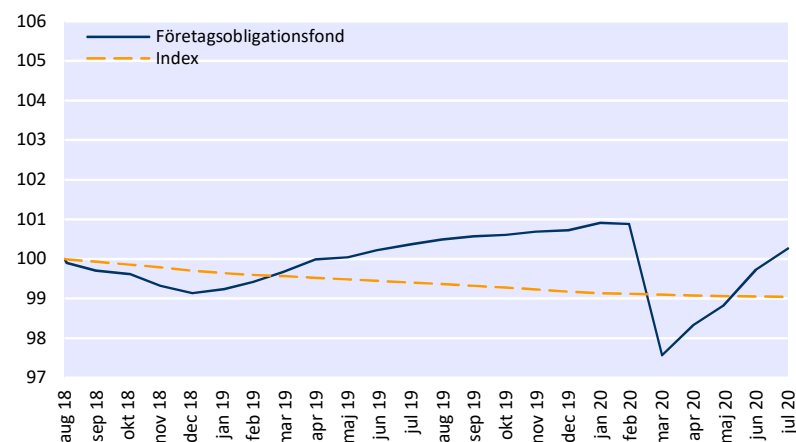
## Överavkastning

### Månatlig överavkastning mot index

## Indexutveckling



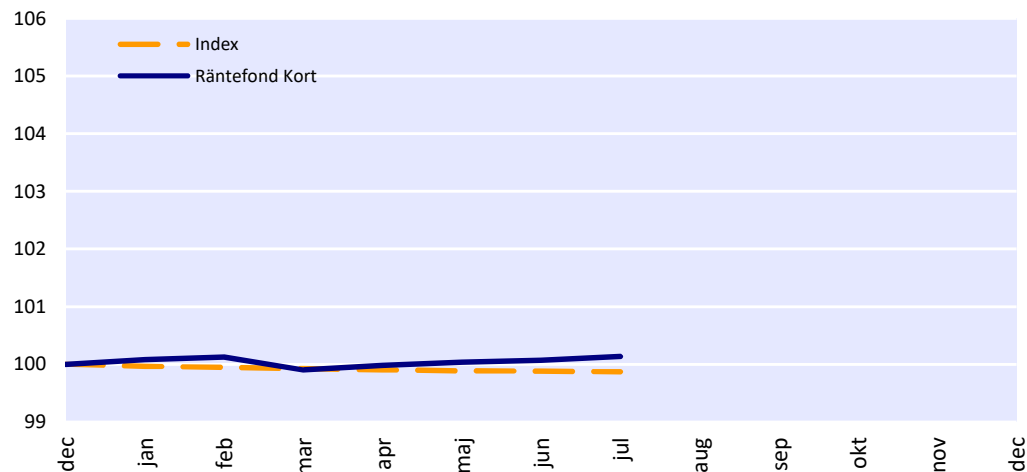
## Utveckling fond vs index



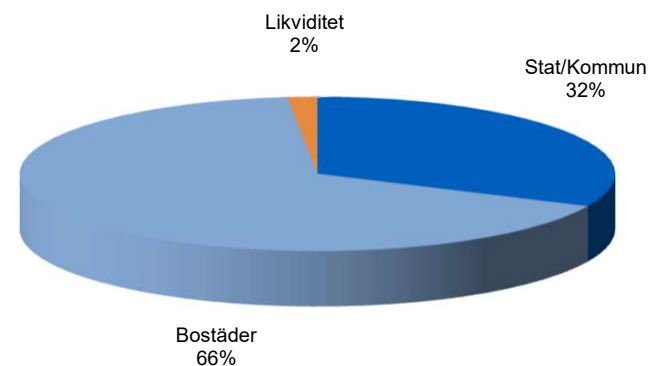
# AMF RÄNTEFOND KORT

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

**Utveckling**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Räntefond Kort**  
Emittentfördelning, %



| Räntefond Kort                        |            |
|---------------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar                  | 57 577 800 |
| Total förmögenhet MSEK                | 6 413,7    |
| Likviditet *                          | 1,6%       |
| Duration                              | 0,78       |
| Modifierad duration                   | 0,78%      |
| Modifierad duration krediter          | 0,81%      |
| Yield                                 | 0,05%      |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 1,56       |
| Avkastning från årets början          | 0,13%      |
| Avkastning index                      | -0,13%     |
| Nav-kurs                              | 111,39     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största räntebärande emittenter | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Kommuninvest                    | 18,3             |
| Nordea Hypotek                  | 15,4             |
| Skandiabanken                   | 15,0             |
| Nykredit                        | 14,5             |
| Stadshypotek                    | 11,2             |
|                                 | <b>74,4</b>      |

# AMF RÄNTEFOND KORT

## Perioden 150731-200731 (5 år) \*

Marknadsvärde (MSEK) 6 413,7

Avkastning - portfölj -1,27%

Avkastning - index -3,06%

Skillnad 1,80%

Riskindikator 1

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating \*\* -

Volatilitet - portfölj 0,2%

Volatilitet - index 0,1%

Aktiv risk 0,2%

Info. kvot 1,93

Sharpekvot - portfölj 1,85

Jensens alfa 0,4%

Beta 0,87

Förklaringsgrad 7,7%

Konsistens 88,3%

|                      | 2020    | 2019    | 2018    | 2017    | 2016    | 2015    | 2014    |
|----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 6 413,7 | 4 443,6 | 5 252,2 | 4 834,0 | 5 384,6 | 6 380,6 | 6 815,4 |

Avkastning - portfölj 0,13%

Avkastning - index -0,13%

Skillnad 0,27%

|                       | 1 mån  | 3 mån  | 6 mån  | 1 år   | 3 år   | 5 år   | Start*** |
|-----------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|
| Avkastning - portfölj | 0,06%  | 0,15%  | 0,05%  | -0,13% | -0,85% | -1,27% | 1,61%    |
| Avkastning - index    | -0,01% | -0,03% | -0,09% | -0,36% | -1,78% | -3,06% | 0,92%    |
| Skillnad              | 0,07%  | 0,19%  | 0,15%  | 0,24%  | 0,94%  | 1,80%  | 0,69%    |

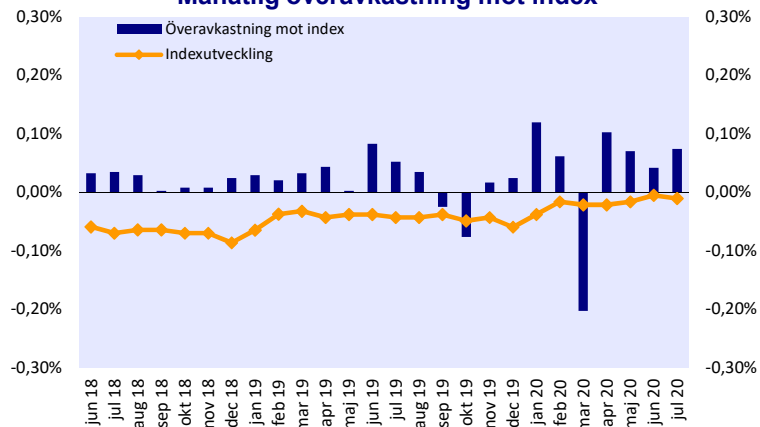
Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

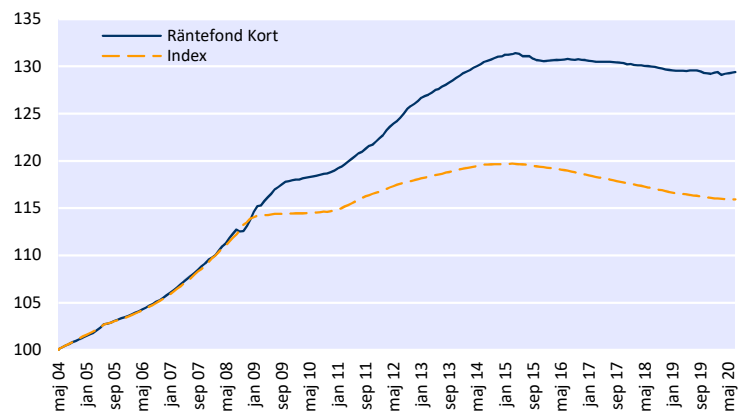
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

## Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



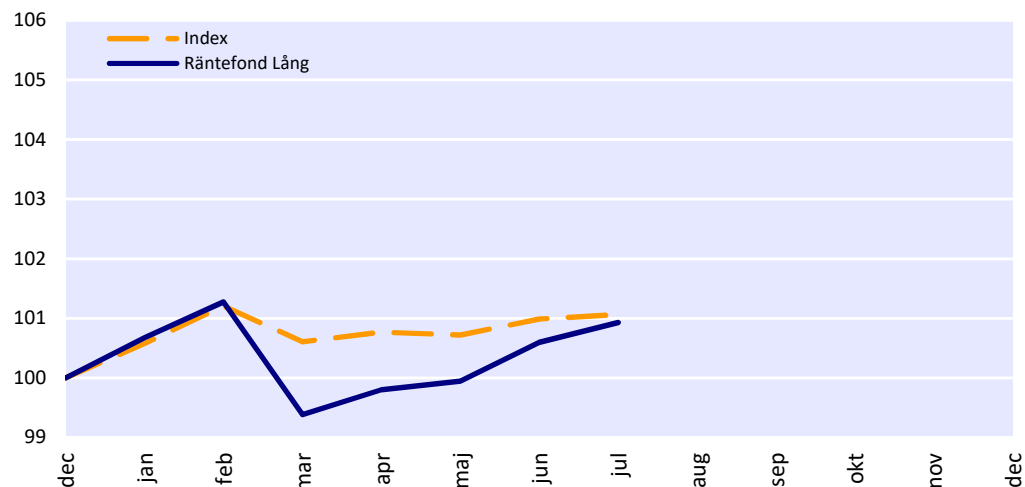
## Utveckling fond vs index



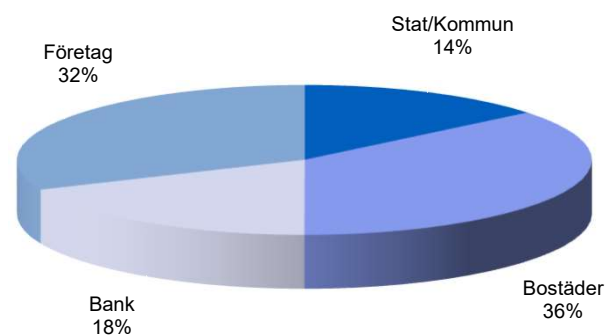
# AMF RÄNTEFOND LÅNG

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

**Utveckling**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Räntefond Lång**  
Emittentfördelning, %



| Räntefond Lång                        |            |
|---------------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar                  | 57 911 451 |
| Total förmögenhet MSEK                | 8 707,8    |
| Likviditet *                          | -9,1%      |
| Duration                              | 4,06       |
| Modifierad duration                   | 4,03%      |
| Modifierad duration krediter          | 2,69%      |
| Yield                                 | 0,72%      |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 3,73       |
| Avkastning från årets början          | 0,93%      |
| Avkastning Index                      | 1,06%      |
| Nav-kurs                              | 150,36     |

\*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största räntebärande emittenter | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Stat Sverige                    | 15,4             |
| SEB Bolån                       | 11,4             |
| Swedbank hypotek                | 8,9              |
| SBAB                            | 8,0              |
| Scania                          | 5,2              |
|                                 | <b>48,9</b>      |

# AMF RÄNTEFOND LÅNG

## Perioden 150731-200731 (5 år) \*

Marknadsvärde (MSEK) 8 707,8

Avkastning - portfölj 7,3%

Avkastning - index 6,1%

Skillnad 1,2%

Riskindikator 2

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating \*\* 5

Volatilitet - portfölj 1,8%

Volatilitet - index 1,6%

Aktiv risk 0,7%

Info. kvot 0,36

Sharpekvot - portfölj 1,12

Jensens alfa 0,0%

Beta 1,10

Förklaringsgrad 88,1%

Konsistens 81,7%

|                      | 2020    | 2019    | 2018    | 2017    | 2016    | 2015    | 2014    |
|----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 8 707,8 | 8 621,8 | 8 077,9 | 6 970,1 | 7 328,8 | 6 501,6 | 6 075,9 |

Avkastning - portfölj 0,9% 1,7% 1,2% 0,7% 3,3% 0,5% 8,1%

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

Skillnad -0,1% 0,5% 0,1% 0,3% 0,5% 0,0% 0,5%

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

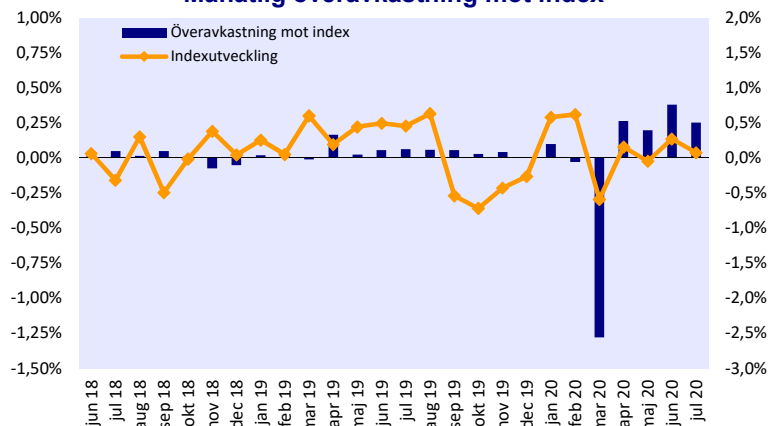
Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

\* Alla värden beräknas inkl avgifter

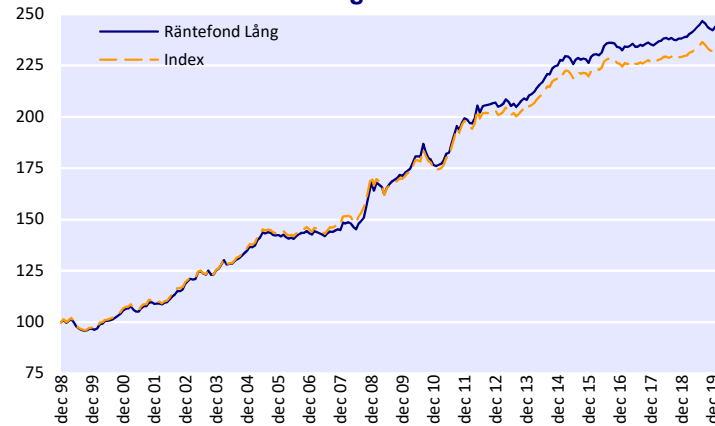
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

## Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



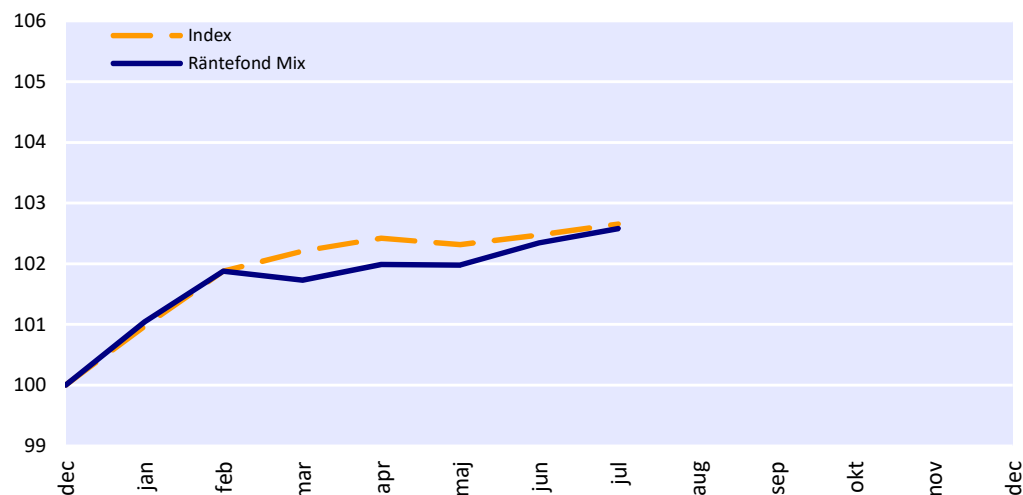
## Utveckling fond vs index



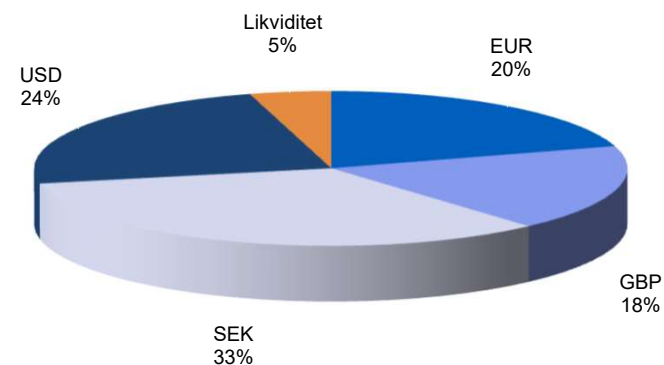
# AMF RÄNTEFOND MIX

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**  
2019-12-31 - 2020-12-31



**Placeringar i Räntefond Mix**  
Emittentfördelning, %



## Räntefond Mix

|                                       |            |
|---------------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar                  | 29 149 996 |
| Total förmögenhet MSEK                | 3 525,1    |
| Likviditet *                          | 4,4%       |
| Duration                              | 4,47       |
| Modifierad duration                   | 4,46%      |
| Modifierad duration krediter          | 2,11%      |
| Yield                                 | 0,12%      |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 4,43       |
| Avkastning från årets början          | 2,58%      |
| Avkastning Index                      | 2,65%      |
| Nav-kurs                              | 120,93     |

## Största räntebärande emittenter

| Största räntebärande emittenter | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Stat USA                        | 22,0             |
| Stat Storbritannien             | 17,4             |
| Stat Tyskland                   | 14,5             |
| Stat Sverige                    | 11,8             |
| Stat Italien                    | 5,2              |
|                                 | <b>70,9</b>      |

# AMF RÄNTEFOND MIX

## Perioden 150731-200731 (5 år) \*

Marknadsvärde (MSEK) 3 525,1

Avkastning - portfölj 5,8%

Avkastning - index 5,2%

Skillnad 0,6%

Riskindikator 3

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating \*\* -

Volatilitet - portfölj 1,9%

Volatilitet - index 1,9%

Aktiv risk 0,3%

Info. Kvot 0,40

Sharpekvot - portfölj 0,91

Jensens alfa 0,2%

Beta 0,98

Förklaringsgrad 97,9%

Konsistens 65,0%

|                      | 2020    | 2019    | 2018    | 2017  | 2016  | 2015  | 2014  |
|----------------------|---------|---------|---------|-------|-------|-------|-------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 3 525,1 | 1 790,2 | 1 285,9 | 990,9 | 905,7 | 764,1 | 827,2 |

Avkastning - portfölj 2,6%

Avkastning - index 2,7%

Skillnad -0,1%

1 mån 3 mån 6 mån 1 år 3 år 5 år Start\*\*\*

Avkastning - portfölj 0,2%

Avkastning - index 0,2%

Skillnad 0,1%

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

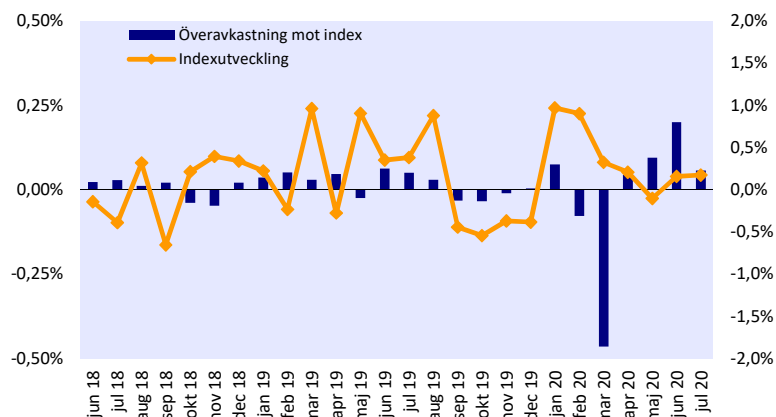
\*\* Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

\*\*\* Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

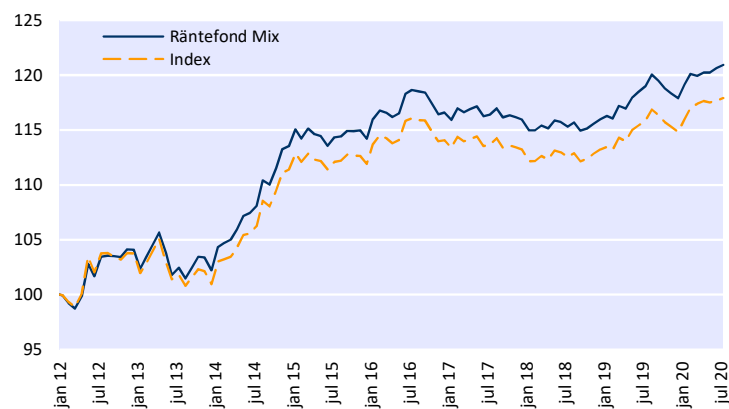
## Överavkastning

## Månatlig överavkastning mot index

## Indexutveckling



## Utveckling fond vs index



# DEFINITIONER

---

|                                          |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
|------------------------------------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| <b>Avkastning</b>                        | Avkastningen avser den värdeökning alternativt värdeminskning som uppstått från periodens början till dess slut, inklusive direktavkastning.                                                                                                                                                                                                                    |
| <b>Duration</b>                          | Duration är en räntefonds genomsnittliga återbetalningstid, vägd med kassaströmmarnas nuvärde.                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Modifierad Duration</b>               | 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.                                                                                                                                                   |
| <b>Yield</b>                             | Förväntad avkastning vid oförändrad räntenivå.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Modifierad Duration Krediter</b>      | Modifierad duration på alla innehav exklusive sådana utgivna av stater.                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| <b>Genomsnittlig löptid till förfall</b> | En sammanvägning av alla innehavs löptid till slutligt förfall.                                                                                                                                                                                                                                                                                                 |
| <b>Volatilitet</b><br>(total risk)       | 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.                                                                     |
| <b>Aktiv risk</b><br>(Tracking Error)    | 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. |
| <b>Informationskvot</b>                  | 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.                                                                                                                                         |
| <b>Sharpekvot</b>                        | 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.                                                                                                                                                                                |
| <b>Jensens alfa</b>                      | 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.                                                                                        |
| <b>Beta</b>                              | 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 marknadsens svängningar försvagas och beta > 1 betyder att marknadsens svängningar förstärks.                                                                               |
| <b>Förklaringsgrad</b>                   | Förklaringsgraden anger hur starkt sambandet är mellan en fond och dess index.                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| <b>Konsistens</b>                        | 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.                                                                                                                                                           |