

AMF Fonder AB - Månadsrapport

per 2020-10-31

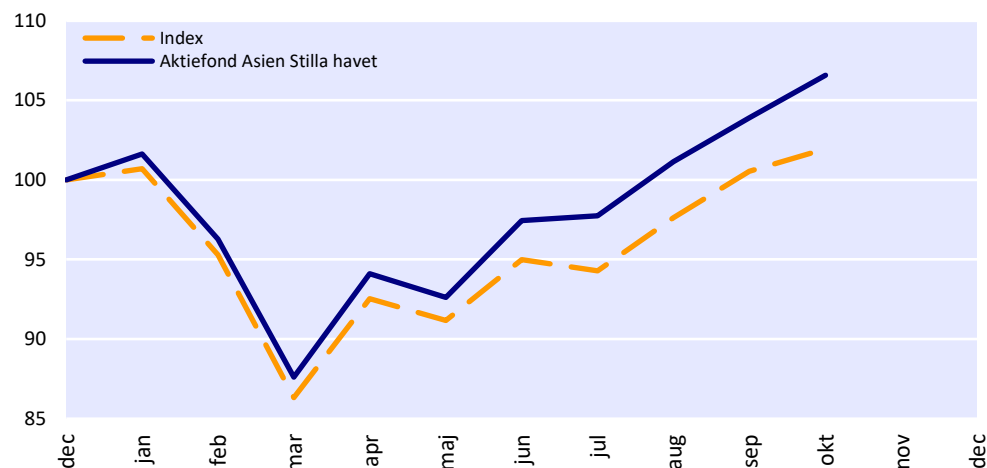


AMF Fonder AB, 113 88 Stockholm
Besöksadress: Klara Södra Kyrkogata 18
Telefon 08-696 31 00
www.amf.se
Org nr 556549-2922 Bolagets säte: Stockholm

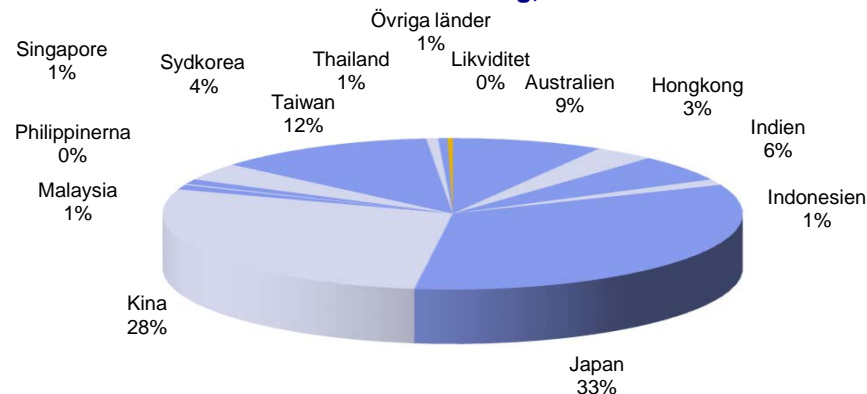
AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Asien och Stillahavsområdet.

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



Placeringar i Aktiefond Asien Stilla havet
Länderfördelning, %



| Aktiefond Asien Stilla havet | |
|------------------------------|-----------|
| Totalt antal andelar | 5 836 321 |
| Total förmögenhet MSEK | 1 489,8 |
| Likviditet * | 0,3% |
| Avkastning från årets början | 6,57% |
| Avkastning Index | 1,94% |
| Nav-kurs | 255,26 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Alibaba Group Holding, Kina | 9,6 |
| Tencent Holdings, Kina | 9,6 |
| Taiwan Semiconductor Manufactur | 8,2 |
| Sony, Japan | 4,5 |
| Meituan Dianping, Kina | 3,1 |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|-------------------------------------|------------------|
| Murata Manufacturing, Japan | 3,0 |
| Keyence, Japan | 2,8 |
| Hong Kong Exchange & Clearing, Hong | 2,8 |
| Goodman Group, Australien | 2,6 |
| Sumitomo Mitsui Financial, Japan | 2,1 |
| Totalt | 48,4 |

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

AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

| Perioden 151031-201031 (5 år)* | |
|--------------------------------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 1 489,8 |

| | |
|-----------------------|-------|
| Avkastning - portfölj | 67,1% |
| Avkastning - index | 59,6% |
| <i>Skillnad</i> | 7,5% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 6 |
| Hållbarhetsbetyg | 5 |
| Morningstar rating ** | 5 |
| Volatilitet - portfölj | 12,3% |
| Volatilitet - index | 12,3% |
| Aktiv risk | 1,3% |
| Info. Kvot | 0,78 |
| Sharpekvot - portfölj | 0,93 |
| Jensens alfa | 1,1% |
| Beta | 0,99 |
| Förklaringsgrad | 98,9% |
| Konsistens | 61,7% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|----------------------|---------|---------|-------|-------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 1 489,8 | 1 305,1 | 918,9 | 979,3 | 1 584,8 | 1 319,4 | 1 187,4 |

| | | | | | | | |
|-----------------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| Avkastning - portfölj | 6,6% | 28,3% | -5,6% | 17,2% | 11,1% | 6,5% | 14,7% |
| Avkastning - index | 1,9% | 28,5% | -6,8% | 17,6% | 13,1% | 8,1% | 18,9% |
| <i>Skillnad</i> | 4,6% | -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 | 2,6% | 9,0% | 13,2% | 9,4% | 32,1% | 67,1% | 8,9% |
| Avkastning - index | 1,4% | 8,1% | 10,2% | 4,3% | 24,8% | 59,6% | 9,3% |
| <i>Skillnad</i> | 1,2% | 0,9% | 3,1% | 5,2% | 7,2% | 7,5% | -0,4% |

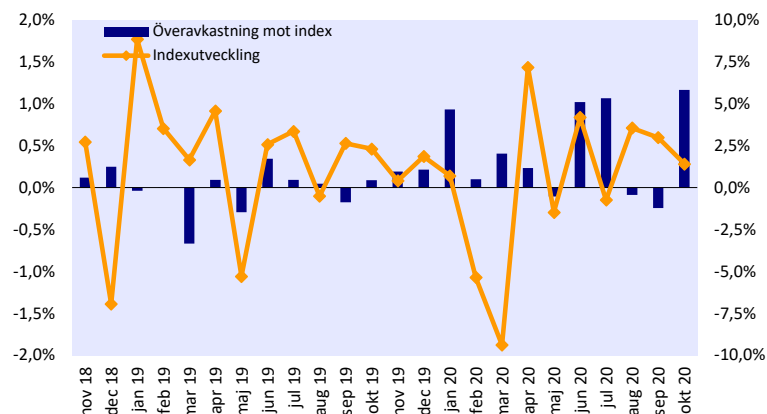
Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Asia Pacific NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

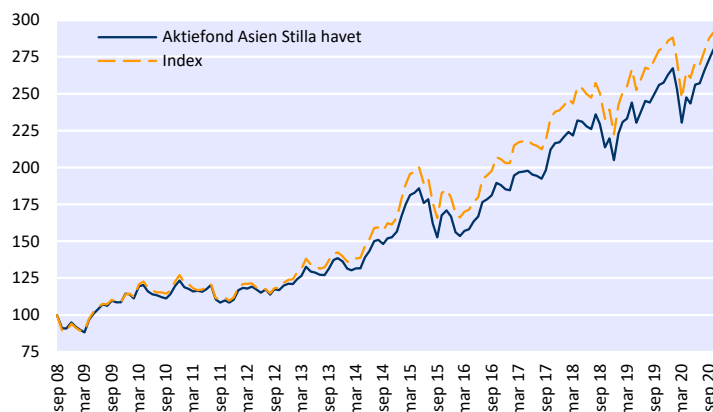
** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



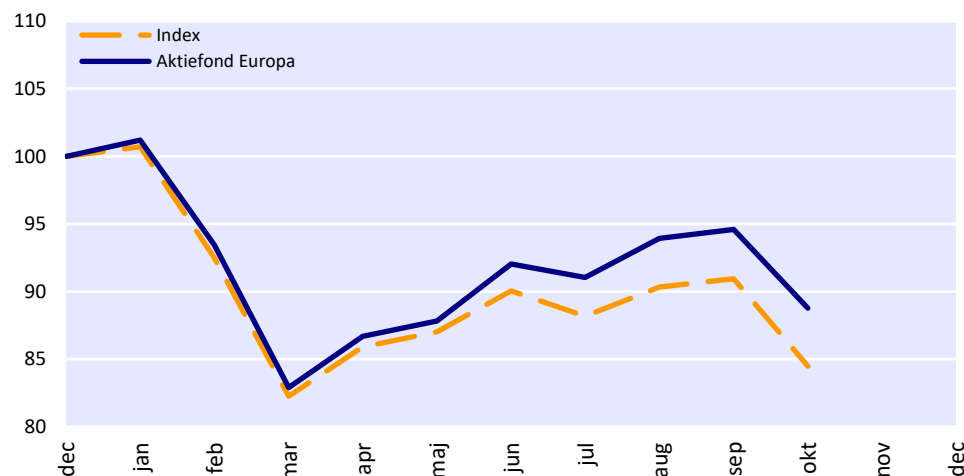
Utveckling fond vs index



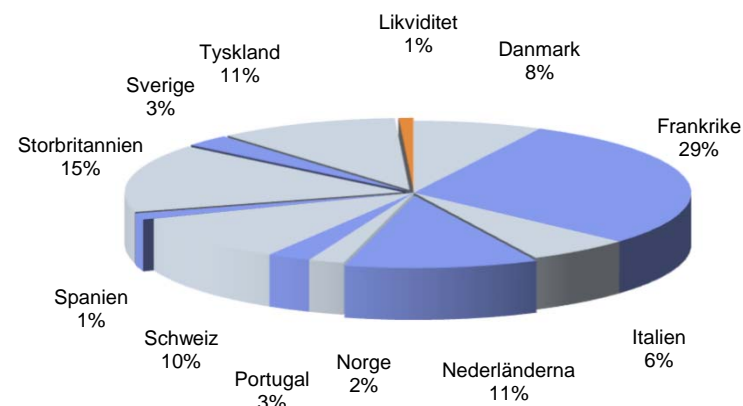
AMF AKTIEFOND EUROPA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Europa.

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



Placeringar i Aktiefond Europa
Länderfördelning, %



| Aktiefond Europa | |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar | 23 558 048 |
| Total förmögenhet MSEK | 4 781,8 |
| Likviditet * | 0,8% |
| Avkastning från årets början | -11,24% |
| Avkastning Index | -15,53% |
| Nav-kurs | 202,98 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav | Portfoljandel, % |
|------------------------------|------------------|
| Roche, Schweiz | 6,1 |
| Saint Gobain, Frankrike | 3,9 |
| Enel, Italien | 3,7 |
| Vestas Wind Systems, Danmark | 3,6 |
| SAP, Tyskland | 3,4 |

| Största aktieinnehav | Portfoljandel, % |
|-----------------------|------------------|
| Tesco, Storbritannien | 3,2 |
| Total, Frankrike | 3,1 |
| Atos SE, Frankrike | 3,0 |
| Michelin, Frankrike | 3,0 |
| Vivendi, Frankrike | 2,9 |
| Totalt | 35,8 |

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

AMF AKTIEFOND EUROPA

| Perioden 151031-201031 (5 år) * | |
|---------------------------------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 4 781,8 |
| Avkastning - portfölj | 20,3% |
| Avkastning - index | 17,8% |
| Skillnad | 2,5% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 6 |
| Hållbarhetsbetyg | 4 |
| Morningstar rating ** | 4 |
| Volatilitet - portfölj | 13,7% |
| Volatilitet - index | 13,4% |
| Aktiv risk | 2,2% |
| Info. kvot | 0,20 |
| Sharpekvot - portfölj | 0,32 |
| Jensens alfa | 0,4% |
| Beta | 1,01 |
| Förklaringsgrad | 97,3% |
| Konsistens | 61,7% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 4 781,8 | 5 611,9 | 4 362,4 | 5 558,7 | 4 162,5 | 4 157,7 | 3 449,1 |
| Avkastning - portfölj | -11,2% | 29,6% | -8,9% | 12,1% | 7,0% | 6,4% | 15,5% |
| Avkastning - index | -15,5% | 32,5% | -6,2% | 11,8% | 5,6% | 4,7% | 14,4% |
| Skillnad | 4,3% | -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 | -6,2% | -2,5% | 2,4% | -9,0% | 3,6% | 20,3% | 5,2% |
| Avkastning - index | -7,1% | -4,2% | -1,7% | -13,6% | 4,1% | 17,8% | 3,7% |
| Skillnad | 1,0% | 1,7% | 4,1% | 4,6% | -0,5% | 2,5% | 1,5% |

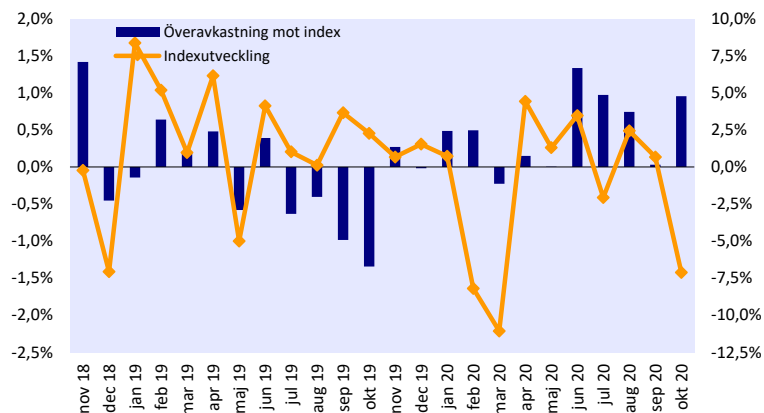
Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Europe NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

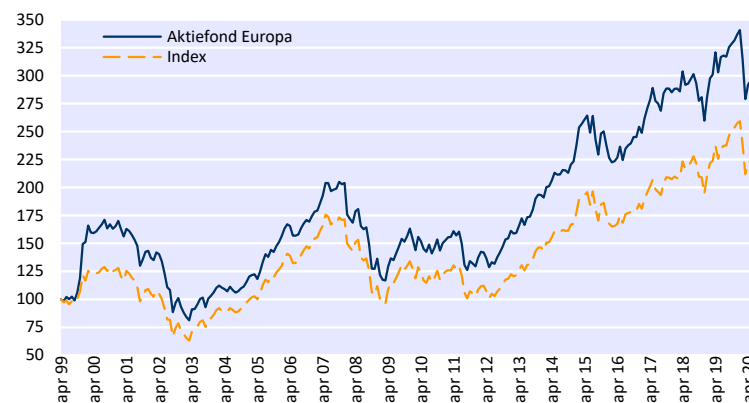
** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



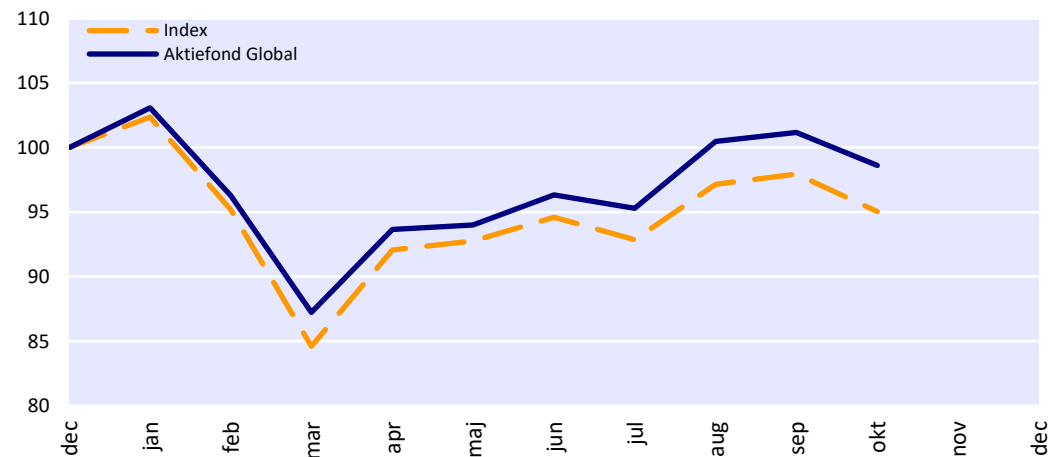
Utveckling fond vs index



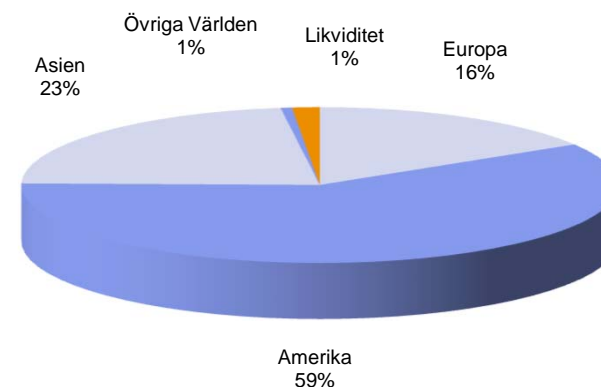
AMF AKTIEFOND GLOBAL

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 | 86 613 641 |
| Total förmögenhet MSEK | 17 895,9 |
| Likviditet * | 1,5% |
| Avkastning från årets början | -1,39% |
| Avkastning Index | -4,96% |
| Nav-kurs | 206,62 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|-----------------------------|------------------|
| Microsoft, USA | 6,1 |
| Alphabet, USA | 4,4 |
| Alibaba Group Holding, Kina | 3,4 |
| Tencent Holdings, Kina | 2,2 |
| Procter & Gamble, USA | 2,2 |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|------------------------------------|------------------|
| Taiwan Semiconductor Manufacturing | 2,2 |
| Visa, USA | 1,5 |
| Merck & Co, USA | 1,5 |
| Coca-Cola, USA | 1,5 |
| PepsiCo, USA | 1,3 |
| Totalt | 26,3 |

AMF AKTIEFOND GLOBAL

| Perioden 151031-201031 (5 år) * | |
|---------------------------------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 17 895,9 |
| Avkastning - portfölj | 62,5% |
| Avkastning - index | 57,6% |
| Skillnad | 4,9% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 5 |
| Hållbarhetsbetyg | 5 |
| Morningstar rating ** | 5 |
| Volatilitet - portfölj | 12,5% |
| Volatilitet - index | 13,3% |
| Aktiv risk | 1,5% |
| Info. kvot | 0,45 |
| Sharpekvot - portfölj | 0,86 |
| Jensens alfa | 1,3% |
| Beta | 0,94 |
| Förklaringsgrad | 99,0% |
| Konsistens | 55,0% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-----------------------|----------|----------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 17 895,9 | 17 424,4 | 3 657,2 | 3 522,8 | 3 188,1 | 2 507,6 | 2 223,9 |
| Avkastning - portfölj | -1,4% | 34,7% | -1,1% | 10,1% | 15,6% | 6,7% | 25,4% |
| Avkastning - index | -5,0% | 34,3% | -1,1% | 10,9% | 16,2% | 5,6% | 27,0% |
| Skillnad | 3,6% | 0,4% | 0,0% | -0,8% | -0,6% | 1,1% | -1,7% |

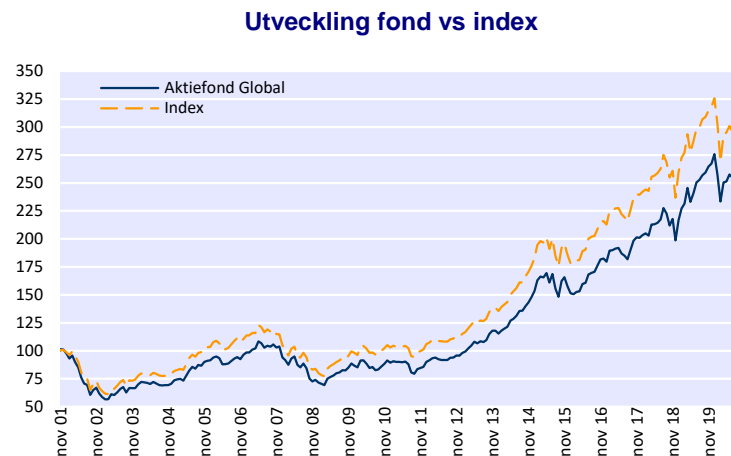
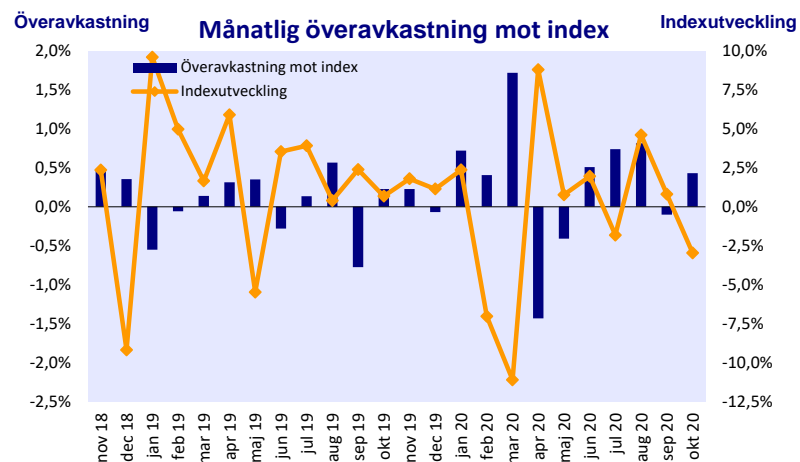
| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | -2,5% | 3,5% | 5,3% | 1,7% | 32,9% | 62,5% | 5,2% |
| Avkastning - index | -3,0% | 2,3% | 3,2% | -2,1% | 27,9% | 57,6% | 6,0% |
| Skillnad | 0,4% | 1,2% | 2,0% | 3,8% | 5,1% | 4,9% | -0,8% |

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

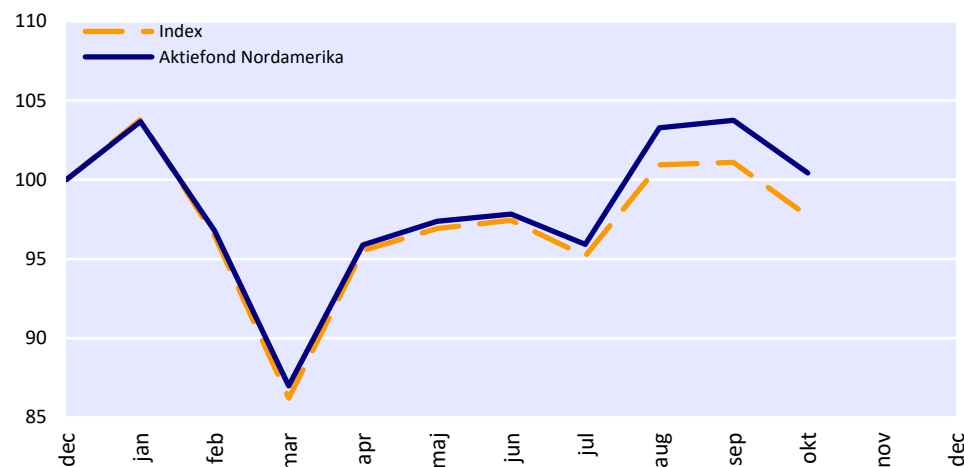
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



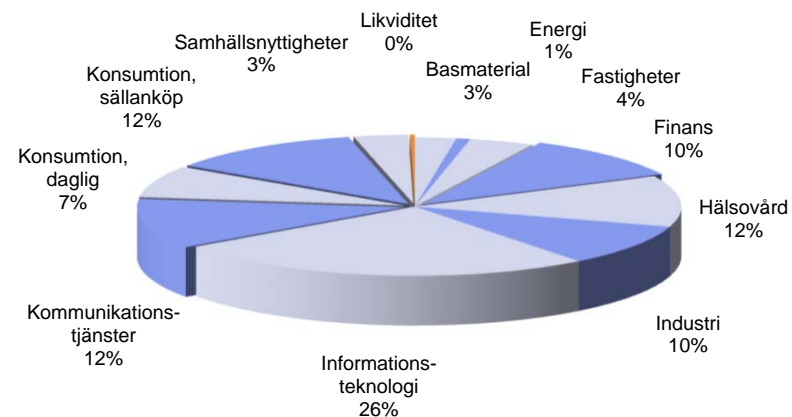
AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

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 | 8 344 037 |
| Total förmögenhet MSEK | 2 621,9 |
| Likviditet * | 0,3% |
| Avkastning från årets början | 0,43% |
| Avkastning Index | -2,28% |
| Nav-kurs | 314,22 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Microsoft | 10,0 |
| Alphabet | 7,8 |
| Procter & Gamble | 3,2 |
| Nvidia | 2,8 |
| Visa | 2,7 |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Merck & Co | 2,4 |
| Home Depot | 2,4 |
| Bristol-Myers Squibb | 2,1 |
| Mastercard A | 2,1 |
| Tesla | 2,1 |
| Totalt | 37,5 |

AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

Perioden 151031-201031 (5 år) *

| | |
|-----------------------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 2 621,9 |
| Avkastning - portfölj | 82,7% |
| Avkastning - index | 77,9% |
| Skillnad | 4,8% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 6 |
| Hållbarhetsbetyg | 5 |
| Morningstar rating ** | 3 |
| Volatilitet - portfölj | 14,1% |
| Volatilitet - index | 14,6% |
| Aktiv risk | 1,3% |
| Info. Kvot | 0,45 |
| Sharpekvot - portfölj | 0,95 |
| Jensens alfa | 1,0% |
| Beta | 0,97 |
| Förklaringsgrad | 99,2% |
| Konsistens | 55,0% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 2 621,9 | 2 826,5 | 1 808,6 | 1 528,3 | 1 751,1 | 1 267,5 | 1 362,0 |

| | | | | | | | |
|-----------------------|-------|-------|------|-------|-------|-------|-------|
| Avkastning - portfölj | 0,4% | 39,0% | 5,3% | 6,9% | 18,7% | 10,1% | 35,8% |
| Avkastning - index | -2,3% | 38,2% | 4,3% | 8,0% | 19,6% | 8,1% | 37,2% |
| Skillnad | 2,7% | 0,7% | 1,0% | -1,1% | -0,9% | 2,0% | -1,5% |

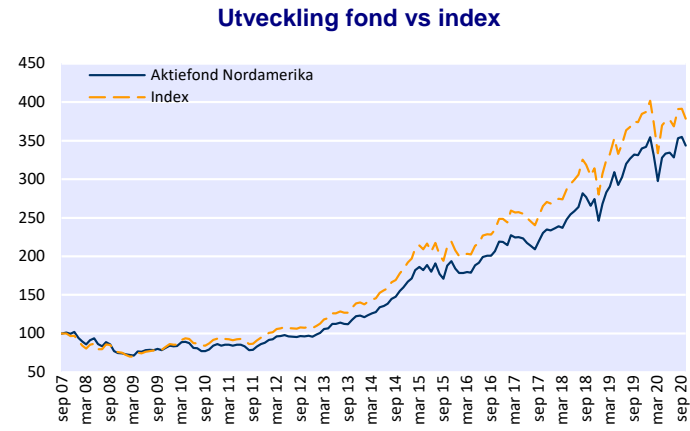
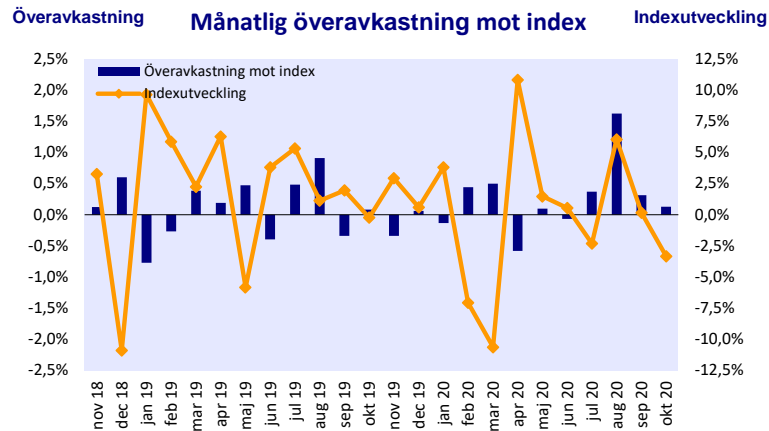
| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | -3,2% | 4,7% | 4,7% | 3,7% | 49,0% | 82,7% | 9,9% |
| Avkastning - index | -3,3% | 2,7% | 2,3% | 1,2% | 42,8% | 77,9% | 10,7% |
| Skillnad | 0,1% | 2,0% | 2,4% | 2,5% | 6,3% | 4,8% | -0,8% |

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

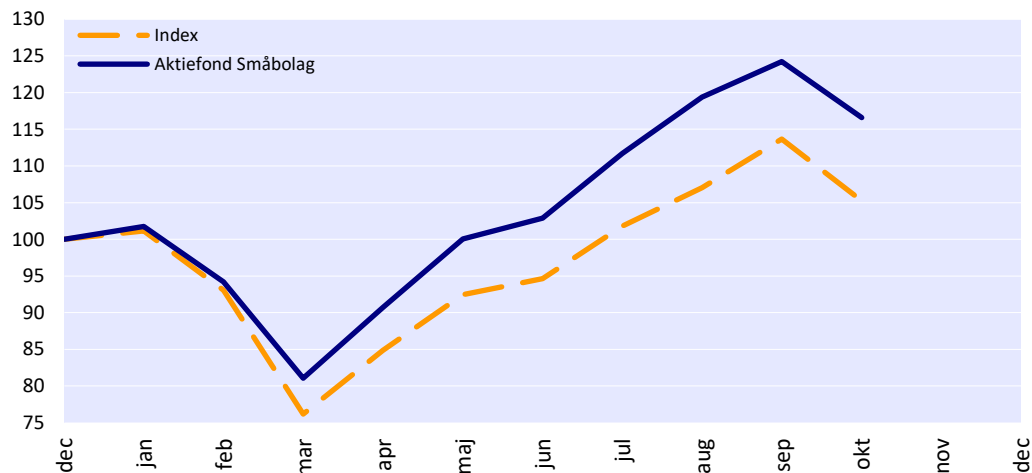
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



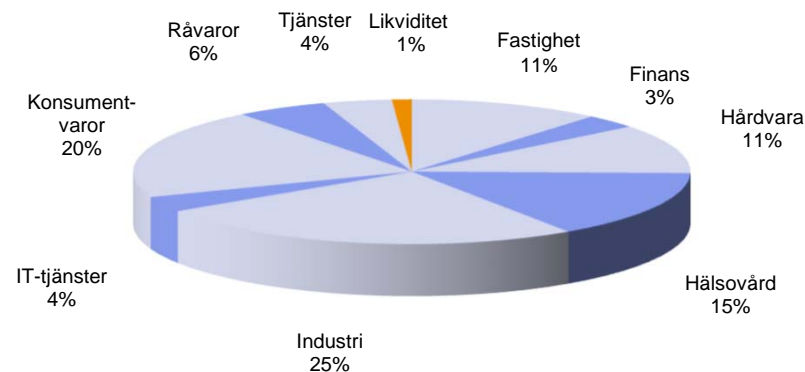
AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

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

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



Placeringar i Aktiefond Småbolag
Branschfördelning, %



Aktiefond Småbolag

| | |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar | 12 994 271 |
| Total förmögenhet MSEK | 12 516,2 |
| Likviditet * | 1,1% |
| Avkastning från årets början | 16,57% |
| Avkastning index | 5,23% |
| Nav-kurs | 963,21 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

Största aktieinnehav

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Sinch | 5,1 |
| Nibe | 3,0 |
| Electrolux | 3,0 |
| Sweco | 2,9 |
| Castellum | 2,7 |

Största aktieinnehav

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Fabege | 2,7 |
| Bure | 2,6 |
| Trelleborg | 2,5 |
| Indutrade | 2,5 |
| Avanza | 2,4 |
| Totalt | 29,4 |

AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

Perioden 151031-201031 (5 år) *

| | |
|-----------------------|--------------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 12 516,2 |
| Avkastning - portfölj | 113,5% |
| Avkastning - index | 93,3% |
| <i>Skillnad</i> | <i>20,2%</i> |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 6 |
| Hållbarhetsbetyg | 4 |
| Morningstar rating ** | 3 |
| Volatilitet - portfölj | 16,8% |
| Volatilitet - index | 17,4% |
| Aktiv risk | 3,2% |
| Info. kvot | 0,72 |
| Sharpekvot - portfölj | 1,01 |
| Jensens alfa | 2,8% |
| Beta | 0,96 |
| Förklaringsgrad | 96,5% |
| Konsistens | 61,7% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-----------------------|--------------|--------------|--------------|-------------|-------------|-------------|--------------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 12 516,2 | 9 803,5 | 6 723,3 | 7 358,6 | 6 492,9 | 5 666,5 | 3 816,1 |
| Avkastning - portfölj | 16,6% | 42,2% | -2,6% | 9,6% | 13,0% | 34,2% | 12,0% |
| Avkastning - index | 5,2% | 43,2% | -0,2% | 8,8% | 12,2% | 30,1% | 21,6% |
| <i>Skillnad</i> | <i>11,3%</i> | <i>-1,0%</i> | <i>-2,4%</i> | <i>0,8%</i> | <i>0,9%</i> | <i>4,2%</i> | <i>-9,5%</i> |

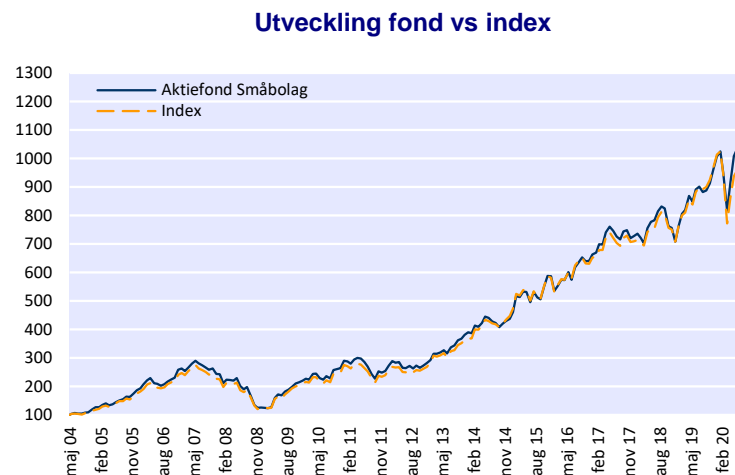
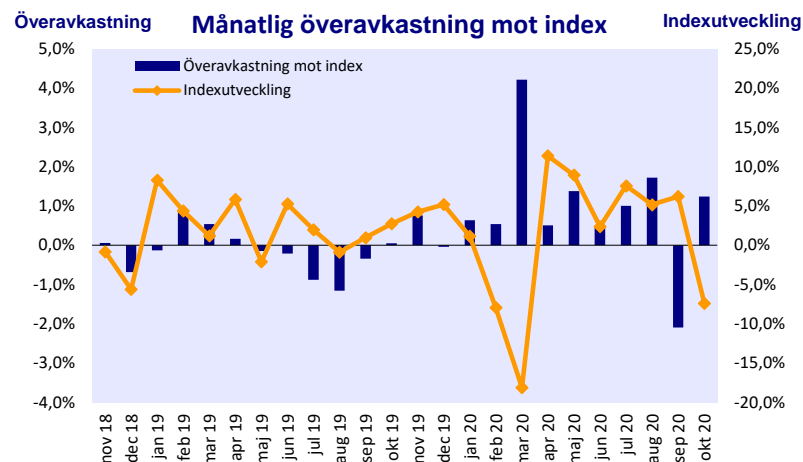
| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|-----------------------|-------------|-------------|-------------|--------------|--------------|--------------|-------------|
| Avkastning - portfölj | -6,2% | 4,4% | 28,5% | 28,7% | 56,9% | 113,5% | 16,1% |
| Avkastning - index | -7,4% | 3,4% | 24,0% | 15,4% | 46,3% | 93,3% | 15,5% |
| <i>Skillnad</i> | <i>1,2%</i> | <i>1,0%</i> | <i>4,5%</i> | <i>13,3%</i> | <i>10,6%</i> | <i>20,2%</i> | <i>0,7%</i> |

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

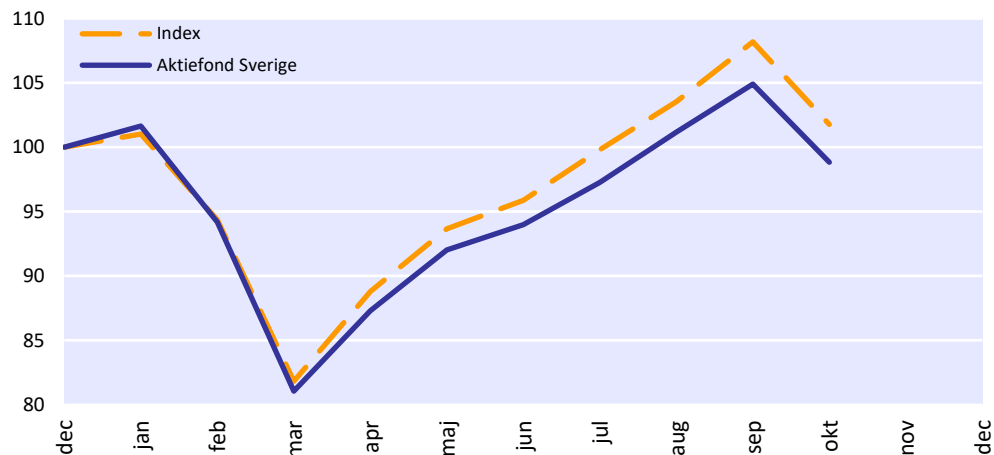
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



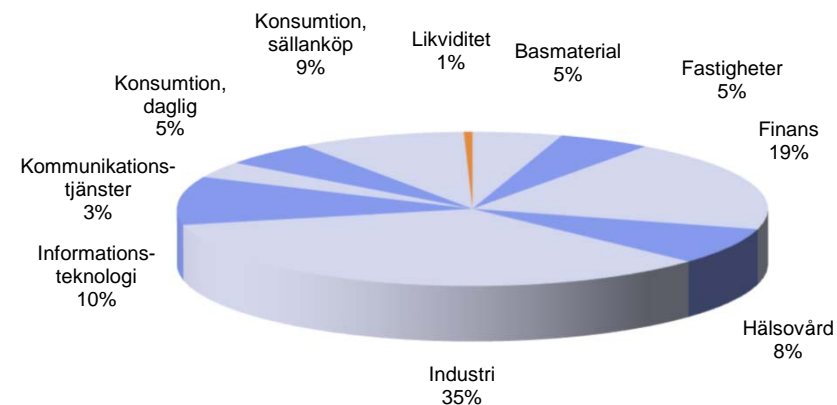
AMF AKTIEFOND SVERIGE

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

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



Placeringar i Aktiefond Sverige
Branschfördelning, %



| Aktiefond Sverige | |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar | 50 271 924 |
| Total förmögenhet MSEK | 32 671,8 |
| Likviditet * | 0,5% |
| Avkastning från årets början | -1,18% |
| Avkastning Index | 1,77% |
| Nav-kurs | 649,90 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: SIXPRX

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Investor | 7,4 |
| Atlas Copco | 6,1 |
| Volvo | 5,3 |
| Hexagon | 4,0 |
| Ericsson | 3,8 |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Hennes & Mauritz | 3,3 |
| Essity | 3,0 |
| Sandvik | 3,0 |
| SEB | 2,7 |
| Kinnevik | 2,7 |
| Totalt | 41,3 |

AMF AKTIEFOND SVERIGE

| Perioden 151031-201031 (5 år) * | |
|---------------------------------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 32 671,8 |
| Avkastning - portfölj | 37,4% |
| Avkastning - index | 53,8% |
| Skillnad | -16,4% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 6 |
| Hållbarhetsbetyg | 5 |
| Morningstar rating ** | 2 |
| Volatilitet - portfölj | 14,7% |
| Volatilitet - index | 14,7% |
| Aktiv risk | 1,8% |
| Info. kvot | -1,36 |
| Sharpekvot - portfölj | 0,49 |
| Jensens alfa | -2,4% |
| Beta | 0,99 |
| Förklaringsgrad | 98,5% |
| Konsistens | 30,0% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 32 671,8 | 33 846,3 | 25 371,6 | 27 691,6 | 27 500,3 | 26 529,6 | 25 074,6 |
| Avkastning - portfölj | -1,2% | 25,7% | -4,9% | 7,9% | 8,6% | 8,6% | 15,4% |
| Avkastning - index | 1,8% | 35,0% | -4,6% | 10,0% | 9,2% | 6,3% | 15,0% |
| Skillnad | -2,9% | -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 | -5,8% | 1,6% | 13,2% | 1,7% | 12,3% | 37,4% | 11,1% |
| Avkastning - index | -5,9% | 2,0% | 14,6% | 7,4% | 24,8% | 53,8% | 9,4% |
| Skillnad | 0,1% | -0,4% | -1,4% | -5,7% | -12,6% | -16,4% | 1,7% |

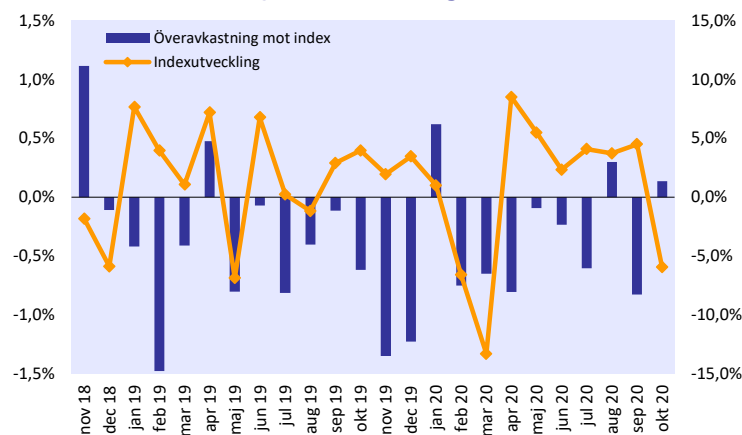
Referensindex: SIXPRX

* Alla värden beräknas inkl avgifter

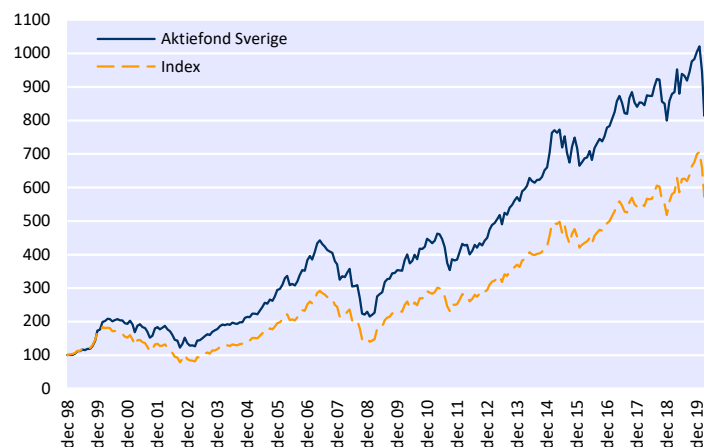
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



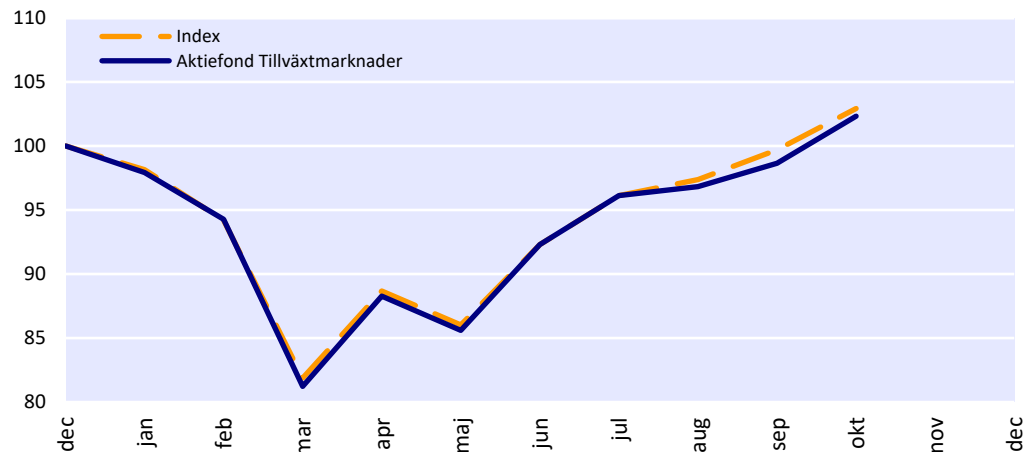
Utveckling fond vs index



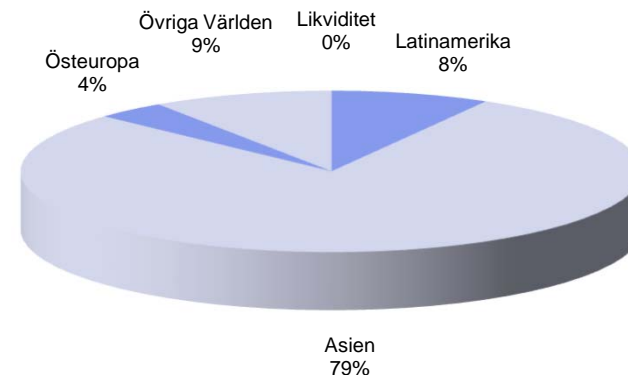
AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

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 | 13 868 785 |
| Total förmögenhet MSEK | 1 481,7 |
| Likviditet * | 0,0% |
| Avkastning från årets början | 2,35% |
| Avkastning Index | 2,95% |
| Nav-kurs | 106,83 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|------------------------------|------------------|
| Tencent Holdings, Kina | 9,7 |
| Alibaba Group Holding, Kina | 9,6 |
| Taiwan Semiconductor Manufac | 9,3 |
| Meituan Dianping, Kina | 4,4 |
| Reliance Industries, Indien | 4,1 |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|-------------------------------|------------------|
| Naspers, Sydafrika | 3,3 |
| Mediatek, Taiwan | 2,7 |
| Wuxi Biologics, Kina | 2,7 |
| Pinduoduo, Kina | 2,4 |
| China Construction Bank, Kina | 1,7 |
| Totalt | 49,7 |

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

AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

Perioden 191211-201031 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK) 1 481,7

Avkastning - portfölj 6,8%
 Avkastning - index 7,5%
 Skillnad -0,7%

Riskindikator 6
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating -
 Volatilitet - portfölj ³⁾ 14,7%
 Volatilitet - index ³⁾ 14,5%
 Aktiv risk ²⁾ -
 Info. Kvot ²⁾ -
 Sharpekvot - portfölj ²⁾ -
 Jensens alfa ²⁾ -
 Beta ²⁾ -
 Förklaringsgrad ²⁾ -
 Konsistens ²⁾ 50,0%

2020 2019

Marknadsvärde (MSEK) 1 481,7 322,2

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

1 mån 3 mån 6 mån Start

Avkastning - portfölj 3,7% 6,5% 16,0% 6,8%
 Avkastning - index 3,2% 7,1% 16,1% 7,5%
 Skillnad 0,5% -0,6% -0,1% -0,7%

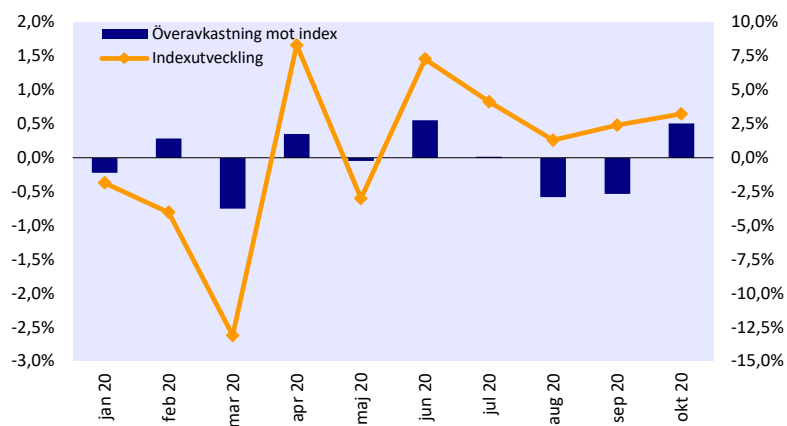
Referensindex: MSCI Emerging Markets ESG Leaders NR (omräkn.sek)

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

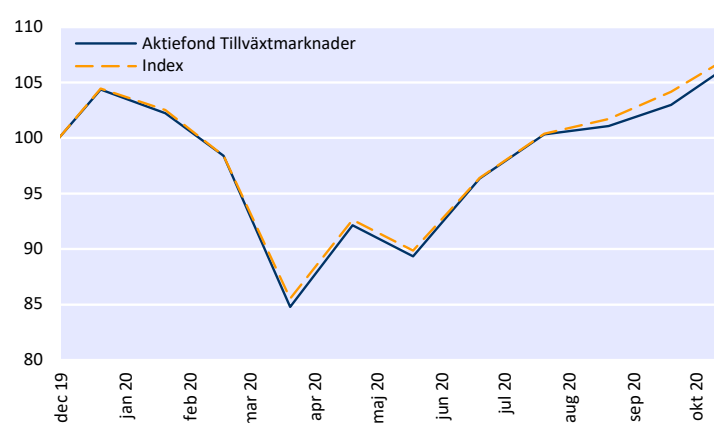
²⁾ Från fondens start

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

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



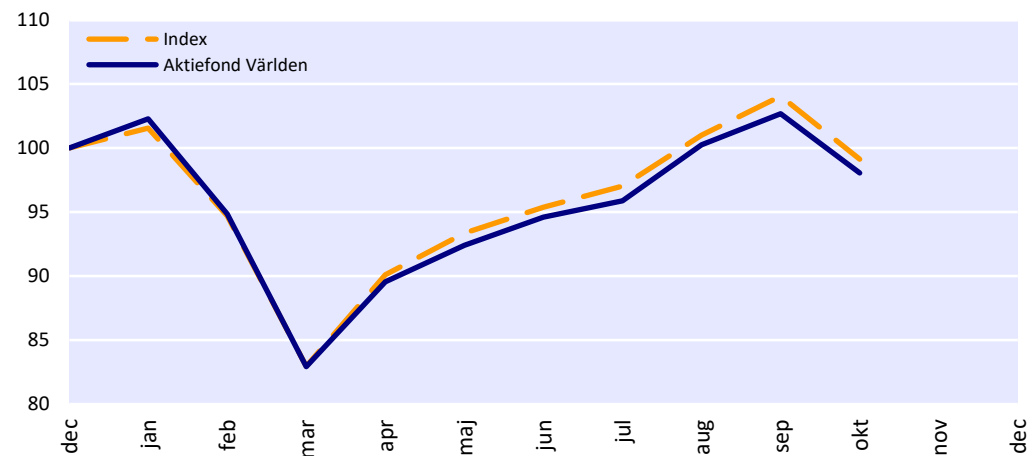
Utveckling fond vs index



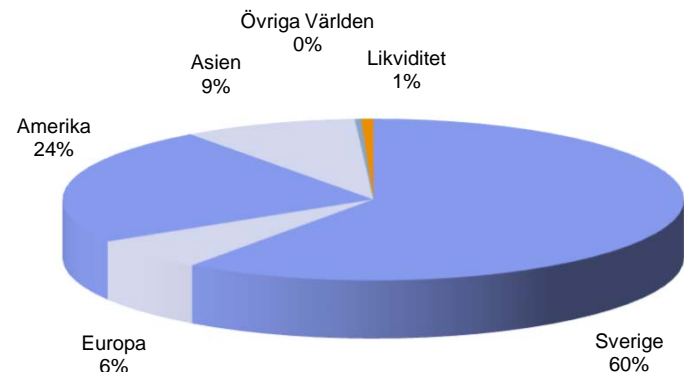
AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

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 | 84 738 835 |
| Total förmögenhet MSEK | 37 212,7 |
| Likviditet * | 0,6% |
| Avkastning från årets början | -1,96% |
| Avkastning Index | -0,88% |
| Nav-kurs | 439,15 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Investor | 4,5 |
| Atlas Copco | 3,5 |
| Volvo | 3,0 |
| Microsoft, USA | 2,7 |
| Hexagon | 2,3 |

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Ericsson | 2,1 |
| Hennes & Mauritz | 1,9 |
| Alphabet, USA | 1,8 |
| Sandvik | 1,7 |
| Essity | 1,6 |
| Totalt | 25,1 |

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

AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

Perioden 151031-201031 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 37 212,7

Avkastning - portfölj 44,7%
 Avkastning - index 55,9%
 Skillnad -11,2%

Riskindikator 6
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating ** 3
 Volatilitet - portfölj 13,5%
 Volatilitet - index 13,6%
 Aktiv risk 1,5%
 Info. kvot -1,04
 Sharpekvot - portfölj 0,61
 Jensens alfa -1,4%
 Beta 0,98
 Förklaringsgrad 98,7%
 Konsistens 36,7%

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 37 212,7 | 39 160,8 | 31 486,5 | 33 731,8 | 32 024,0 | 29 410,8 | 27 898,8 |

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

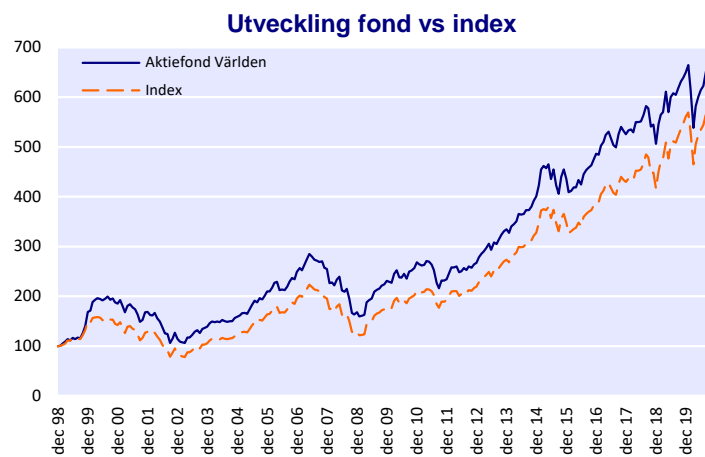
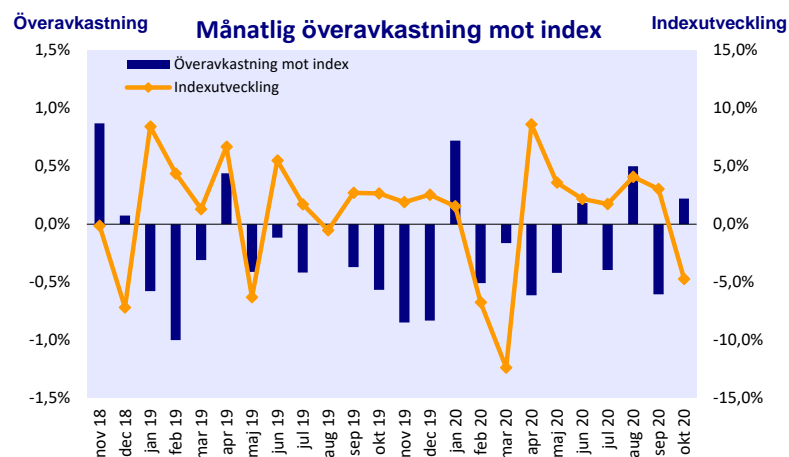
| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|----------|
| Avkastning - portfölj | -4,5% | 2,3% | 9,5% | 0,8% | 17,9% | 44,7% | 8,8% |
| Avkastning - index | -4,7% | 2,1% | 10,0% | 3,6% | 26,4% | 55,9% | 8,2% |
| Skillnad | 0,2% | 0,1% | -0,5% | -2,8% | -8,5% | -11,2% | 0,7% |

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

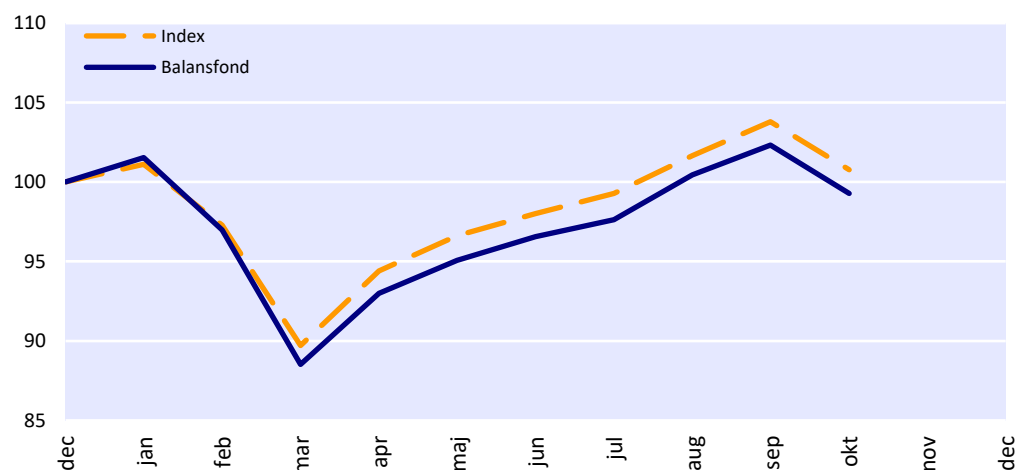
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



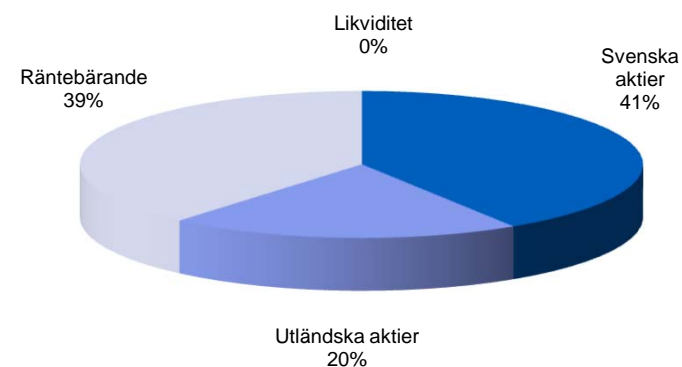
AMF BALANSFOND

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
2019-12-31 - 2020-12-31



Placeringar i Balansfond
fördelning aktier/räntebärande, %



| Balansfond | |
|------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar | 72 578 567 |
| Total förmögenhet MSEK | 22 273,9 |
| Likviditet * | 0,0% |
| Modifierad duration | 4,11% |
| Avkastning från årets början | -0,73% |
| Avkastning Index | 0,76% |
| Nav-kurs | 306,89 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största aktieinnehav | Portföljandel, % |
|----------------------|------------------|
| Investor | 3,1 |
| Atlas Copco | 2,4 |
| Volvo | 2,1 |
| Hexagon | 1,6 |
| Ericsson | 1,5 |
| Totalt | 10,8 |

| Största ränteb. Emittent | Portföljandel, % |
|--------------------------|------------------|
| Stat Sverige | 6,9 |
| SEB Bolån | 4,4 |
| SBAB | 3,5 |
| Scania | 2,1 |
| Swedbank Hypotek | 2,0 |
| Totalt | 19,0 |

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

AMF BALANSFOND

| Perioden 151031-201031 (5 år) * | |
|---------------------------------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 22 273,9 |
| Avkastning - portfölj | 28,3% |
| Avkastning - index | 35,1% |
| Skillnad | -6,8% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 4 |
| Hållbarhetsbetyg | - |
| Morningstar rating ** | 5 |
| Volatilitet - portfölj | 8,5% |
| Volatilitet - index | 8,2% |
| Aktiv risk | 1,1% |
| Info. kvot | -1,04 |
| Sharpekvot - portfölj | 0,67 |
| Jensens alfa | -1,3% |
| Beta | 1,02 |
| Förklaringsgrad | 98,5% |
| Konsistens | 33,3% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-----------------------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|----------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 22 273,9 | 23 265,8 | 20 513,5 | 21 734,7 | 21 288,0 | 20 303,8 | 19 884,5 |
| Avkastning - portfölj | -0,7% | 16,9% | -1,9% | 5,2% | 8,3% | 5,6% | 14,7% |
| Avkastning - index | 0,8% | 20,5% | -1,5% | 6,4% | 8,1% | 4,1% | 14,3% |
| Skillnad | -1,5% | -3,7% | -0,5% | -1,2% | 0,1% | 1,4% | 0,4% |

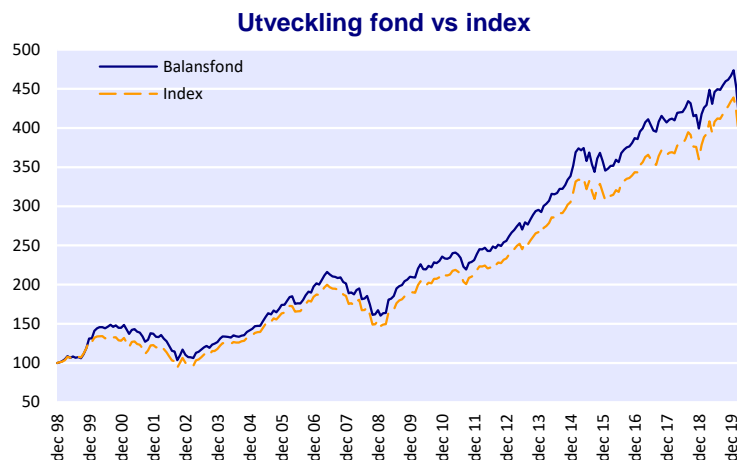
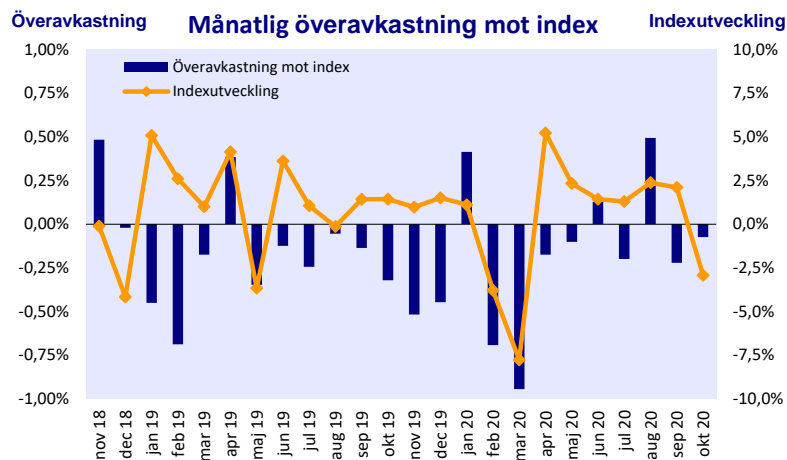
| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|
| Avkastning - portfölj | -3,0% | 1,7% | 6,7% | 0,8% | 11,5% | 28,3% | 7,3% |
| Avkastning - index | -2,9% | 1,5% | 6,7% | 3,3% | 17,7% | 35,1% | 7,0% |
| Skillnad | -0,1% | 0,2% | 0,0% | -2,5% | -6,2% | -6,8% | 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

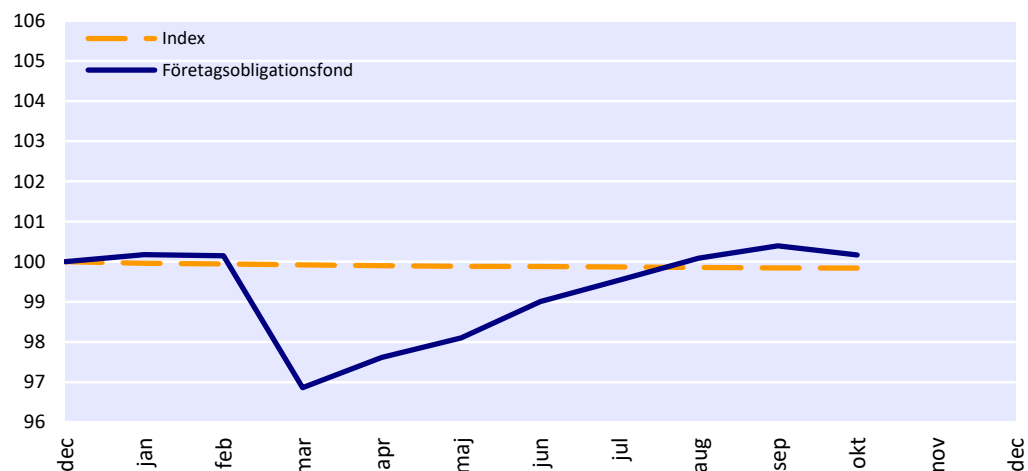
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



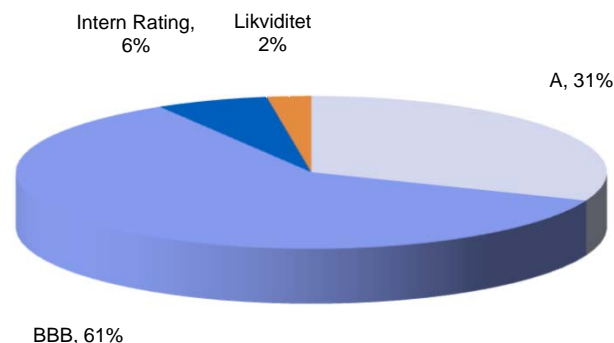
AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

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
2019-12-31 - 2020-12-31



Placeringar i Företagsobligationsfond
Rating, %



| Företagsobligationsfond | |
|---------------------------------------|-----------|
| Totalt antal andelar | 6 880 378 |
| Total förmögenhet MSEK | 694,2 |
| Likviditet * | 2,4% |
| Duration | 0,37 |
| Modifierad duration | 0,37% |
| Modifierad duration krediter | 0,37% |
| Yield | 0,94% |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 2,69 |
| Avkastning från årets början | 0,17% |
| Avkastning index | -0,16% |
| Nav-kurs | 100,90 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

| Största räntebärande emittenter | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Castellum | 7,9 |
| SBAB Bank | 7,7 |
| Hexagon | 6,2 |
| Santander Consumer Bank | 5,7 |
| Atrium Ljungberg | 4,5 |
| | 32,0 |

AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

Perioden 180829-201031 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK) 694,2

Avkastning - portfölj 0,90%

Avkastning - index -0,98%

Skillnad 1,88%

Riskindikator ³⁾ 1

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating -

Volatilitet - portfölj ³⁾ 1,7%

Volatilitet - index ³⁾ 0,1%

Aktiv risk ²⁾ 2,6%

Info. Kvot ²⁾ 0,34

Sharpekvot - portfölj ²⁾ 0,60

Jensens alfa ²⁾ 0,5%

Beta ²⁾ 3,40

Förklaringsgrad ²⁾ 1,1%

Konsistens ²⁾ 73,1%

| | 2020 | 2019 | 2018 |
|----------------------|-------|-------|-------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 694,2 | 641,8 | 536,5 |

| | | | |
|-----------------------|-------|-------|--------|
| Avkastning - portfölj | 0,17% | 1,60% | -0,86% |
|-----------------------|-------|-------|--------|

| | | | |
|--------------------|--------|--------|--------|
| Avkastning - index | -0,16% | -0,53% | -0,30% |
|--------------------|--------|--------|--------|

| | | | |
|-----------------|-------|-------|--------|
| <i>Skillnad</i> | 0,33% | 2,13% | -0,56% |
|-----------------|-------|-------|--------|

| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | Start ⁴⁾ |
|-----------------------|--------|--------|--------|--------|---------------------|
| Avkastning - portfölj | -0,23% | 0,63% | 2,61% | 0,29% | 0,41% |
| Avkastning - index | -0,01% | -0,03% | -0,06% | -0,26% | -0,45% |
| <i>Skillnad</i> | -0,22% | 0,66% | 2,67% | 0,55% | 0,87% |

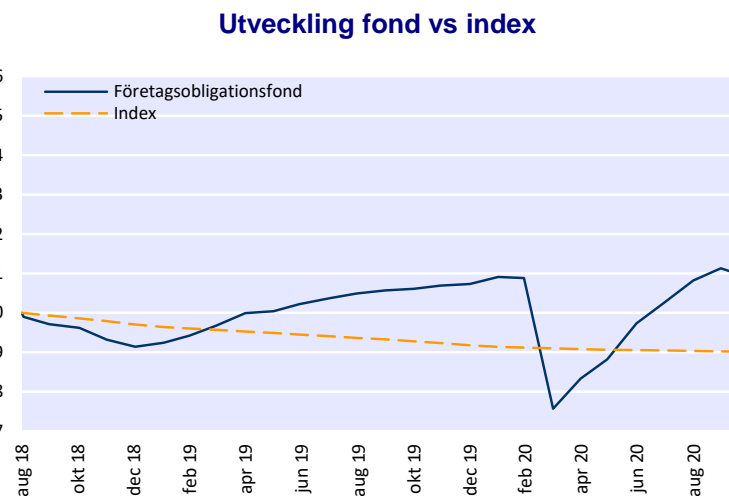
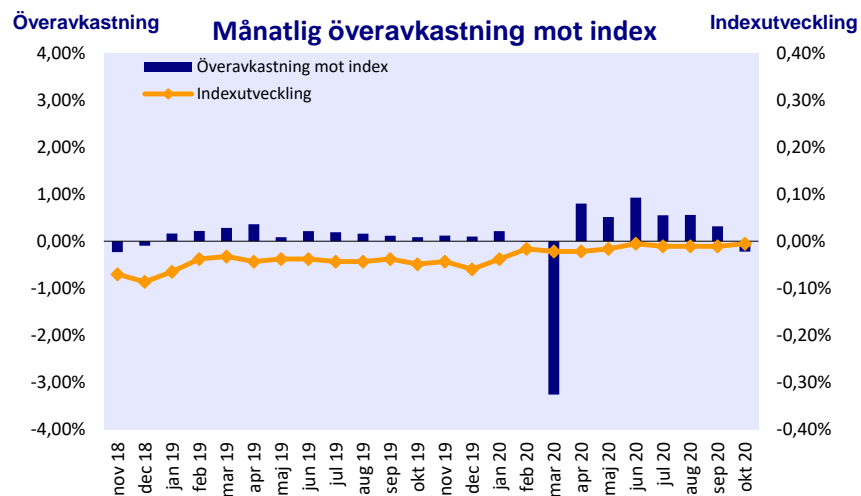
Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

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

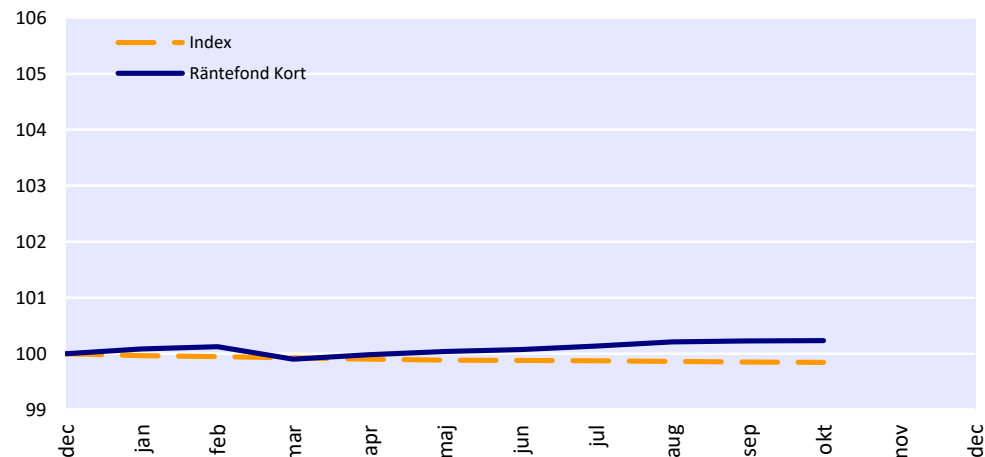
⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



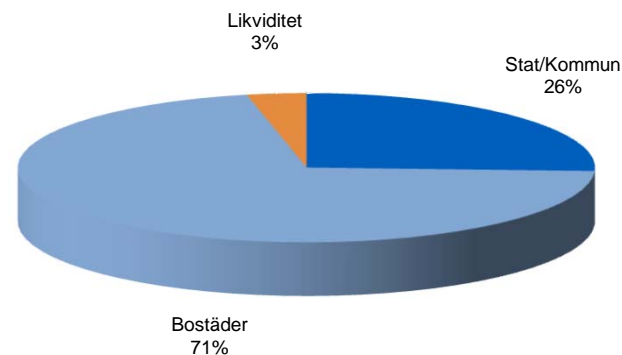
AMF RÄNTEFOND KORT

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 kreditvärldiga företag och organisationer.

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



Placeringar i Råntefond Kort
Emittentfördelning, %



Råntefond Kort

| | |
|---------------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar | 51 916 896 |
| Total förmögenhet MSEK | 5 788,6 |
| Likviditet * | 3,3% |
| Duration | 0,72 |
| Modifierad duration | 0,72% |
| Modifierad duration krediter | 0,72% |
| Yield | -0,02% |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 1,60 |
| Avkastning från årets början | 0,23% |
| Avkastning index | -0,16% |
| Nav-kurs | 111,50 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter

| Emittent | Portföljandel, % |
|----------------|------------------|
| Kommuninvest | 17,9 |
| Skandiabanken | 15,8 |
| Nykredit | 15,3 |
| Stadshypotek | 12,4 |
| Nordea Hypotek | 11,8 |
| Totalt | 73,2 |

AMF RÄNTEFOND KORT

| Perioden 151031-201031 (5 år) * | |
|---------------------------------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 5 788,6 |
| Avkastning - portfölj | -0,88% |
| Avkastning - index | -2,96% |
| Skillnad | 2,08% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 1 |
| Hållbarhetsbetyg | - |
| Morningstar rating ** | - |
| Volatilitet - portfölj | 0,2% |
| Volatilitet - index | 0,1% |
| Aktiv risk | 0,2% |
| Info. kvot | 2,58 |
| Sharpekvot - portfölj | 2,37 |
| Jensens alfa | 0,4% |
| Beta | 0,99 |
| Förklaringsgrad | 15,5% |
| Konsistens | 91,7% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 5 788,6 | 4 443,6 | 5 252,2 | 4 834,0 | 5 384,6 | 6 380,6 | 6 815,4 |
| Avkastning - portfölj | 0,23% | -0,30% | -0,46% | -0,34% | 0,07% | -0,37% | 1,59% |
| Avkastning - index | -0,16% | -0,53% | -0,81% | -0,77% | -0,66% | -0,27% | 0,46% |
| Skillnad | 0,39% | 0,23% | 0,34% | 0,43% | 0,73% | -0,10% | 1,13% |

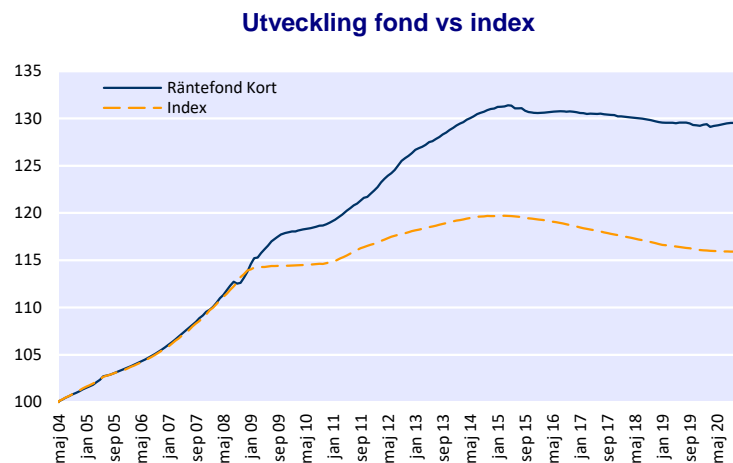
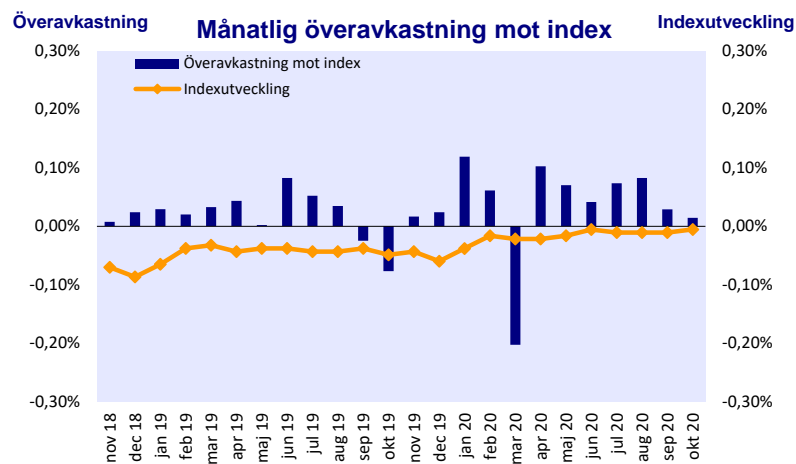
| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|-----------------------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|
| Avkastning - portfölj | 0,01% | 0,10% | 0,25% | 0,17% | -0,65% | -0,88% | 1,58% |
| Avkastning - index | -0,01% | -0,03% | -0,06% | -0,26% | -1,61% | -2,96% | 0,90% |
| Skillnad | 0,01% | 0,13% | 0,31% | 0,43% | 0,96% | 2,08% | 0,68% |

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

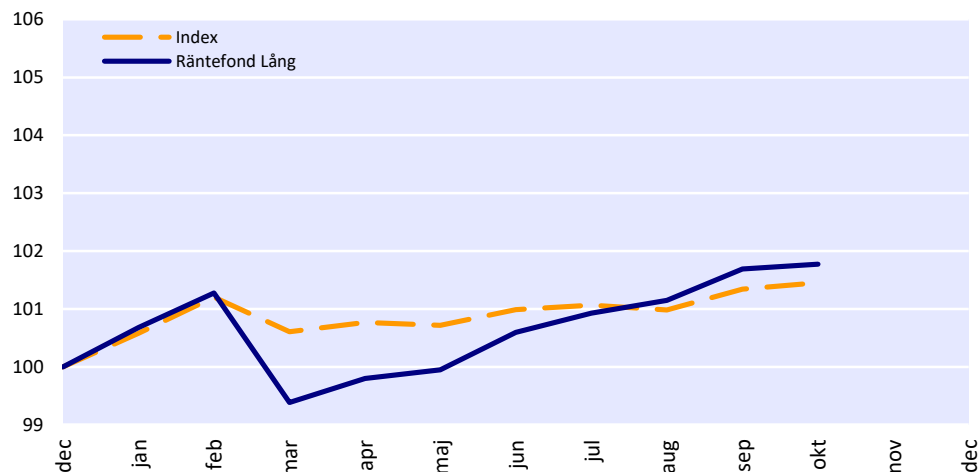
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



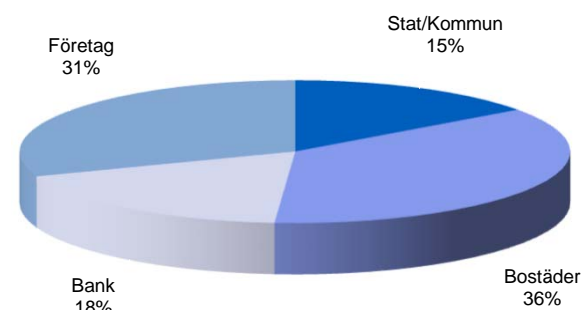
AMF RÄNTEFOND LÅNG

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

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



Placeringar i Räntefond Lång
Emittentfördelning, %



Räntefond Lång

| | |
|---------------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar | 58 694 499 |
| Total förmögenhet MSEK | 8 899,4 |
| Likviditet * | -10,1% |
| Duration | 4,10 |
| Modifierad duration | 4,08% |
| Modifierad duration krediter | 2,62% |
| Yield | 0,48% |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 3,93 |
| Avkastning från årets början | 1,77% |
| Avkastning Index | 1,45% |
| Nav-kurs | 151,62 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

Största räntebärande emittenter

| Emittent | Portföljandel, % |
|------------------|------------------|
| Stat Sverige | 16,6 |
| SEB Bolån | 11,2 |
| SBAB | 9,2 |
| Swedbank hypotek | 7,6 |
| Scania | 5,1 |
| Totalt | 49,6 |

AMF RÄNTEFOND LÅNG

Perioden 151031-201031 (5 år) *

| | |
|-----------------------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 8 899,4 |
| Avkastning - portfölj | 8,0% |
| Avkastning - index | 6,2% |
| <i>Skillnad</i> | 1,7% |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 2 |
| Hållbarhetsbetyg | - |
| Morningstar rating ** | 5 |
| Volatilitet - portfölj | 1,8% |
| Volatilitet - index | 1,5% |
| Aktiv risk | 0,7% |
| Info. kvot | 0,49 |
| Sharpekvot - portfölj | 1,18 |
| Jensens alfa | 0,1% |
| Beta | 1,10 |
| Förklaringsgrad | 87,4% |
| Konsistens | 81,7% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-----------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 8 899,4 | 8 621,8 | 8 077,9 | 6 970,1 | 7 328,8 | 6 501,6 | 6 075,9 |
| Avkastning - portfölj | 1,8% | 1,7% | 1,2% | 0,7% | 3,3% | 0,5% | 8,1% |
| Avkastning - index | 1,5% | 1,2% | 1,0% | 0,4% | 2,8% | 0,5% | 7,5% |
| <i>Skillnad</i> | 0,3% | 0,5% | 0,1% | 0,3% | 0,5% | 0,0% | 0,5% |

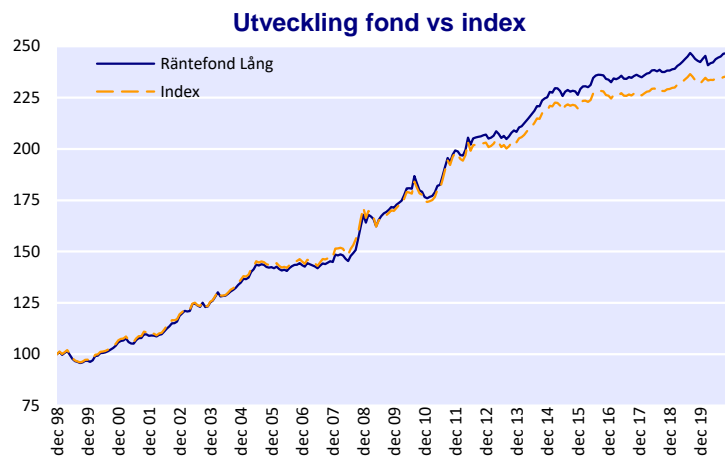
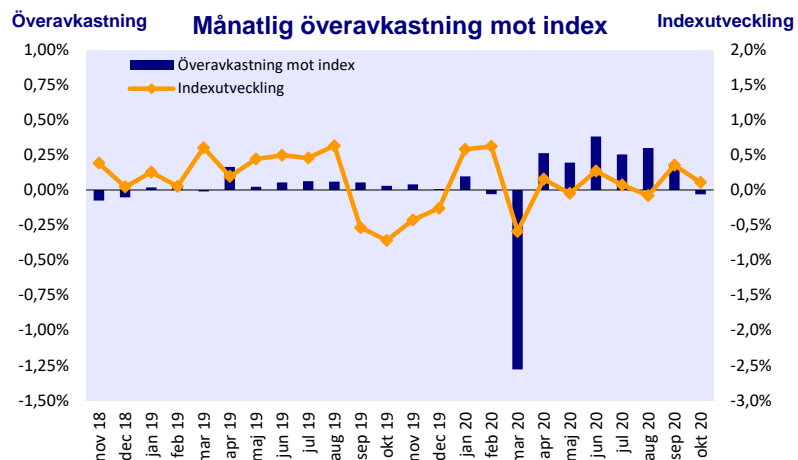
| | 1 mån | 3 mån | 6 mån | 1 år | 3 år | 5 år | Start*** |
|-----------------------|-------|-------|-------|------|------|------|----------|
| Avkastning - portfölj | 0,1% | 0,8% | 2,0% | 1,1% | 4,7% | 8,0% | 4,2% |
| Avkastning - index | 0,1% | 0,4% | 0,7% | 0,8% | 3,7% | 6,2% | 4,0% |
| <i>Skillnad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

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

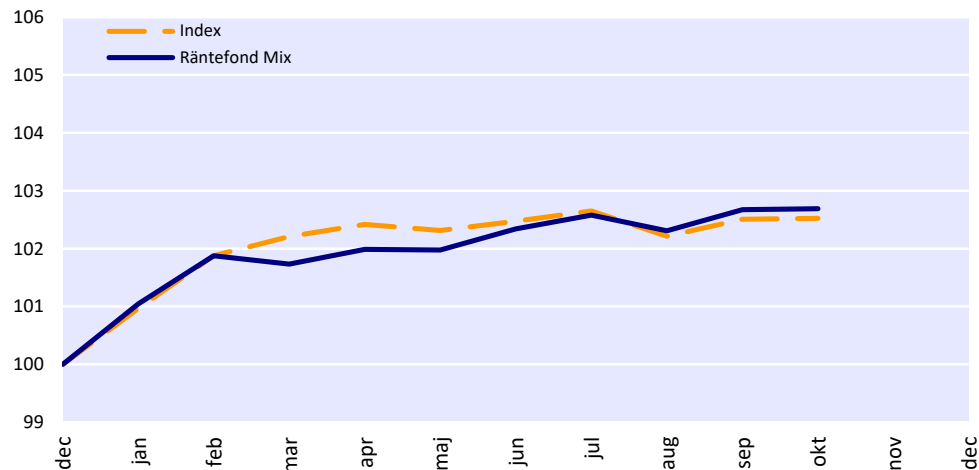
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



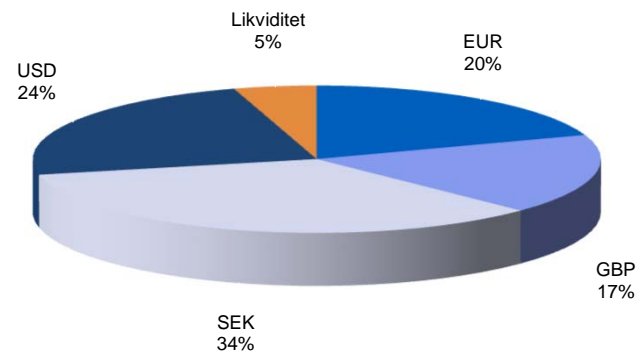
AMF RÄNTEFOND MIX

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

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



Placeringar i Råntefond Mix
Emittentfördelning, %



| Råntefond Mix | |
|---------------------------------------|------------|
| Totalt antal andelar | 30 415 376 |
| Total förmögenhet MSEK | 3 682,0 |
| Likviditet * | 4,7% |
| Duration | 4,38 |
| Modifierad duration | 4,38% |
| Modifierad duration krediter | 2,34% |
| Yield | 0,04% |
| Genomsnittlig löptid till förfall, år | 4,34 |
| Avkastning från årets början | 2,69% |
| Avkastning Index | 2,52% |
| Nav-kurs | 121,06 |

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

| Största räntebärande emittenter | Portföljandel, % |
|---------------------------------|------------------|
| Stat USA | 22,0 |
| Stat Storbritannien | 17,0 |
| Stat Tyskland | 13,7 |
| Stat Sverige | 9,5 |
| Swedbank hypotek | 7,6 |
| Totalt | 69,7 |

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 151031-201031 (5 år) *

| | |
|-----------------------|-------------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 3 682,0 |
| Avkastning - portfölj | 5,4% |
| Avkastning - index | 4,5% |
| <i>Skillnad</i> | <i>0,8%</i> |

| | |
|------------------------|-------|
| Riskindikator | 3 |
| Hållbarhetsbetyg | - |
| Morningstar rating ** | - |
| Volatilitet - portfölj | 1,9% |
| Volatilitet - index | 1,9% |
| Aktiv risk | 0,3% |
| Info. Kvot | 0,56 |
| Sharpekvot - portfölj | 0,86 |
| Jensens alfa | 0,2% |
| Beta | 0,98 |
| Förklaringsgrad | 97,8% |
| Konsistens | 68,3% |

| | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|----------------------|---------|---------|---------|-------|-------|-------|-------|
| Marknadsvärde (MSEK) | 3 682,0 | 1 790,2 | 1 285,9 | 990,9 | 905,7 | 764,1 | 827,2 |

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

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

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

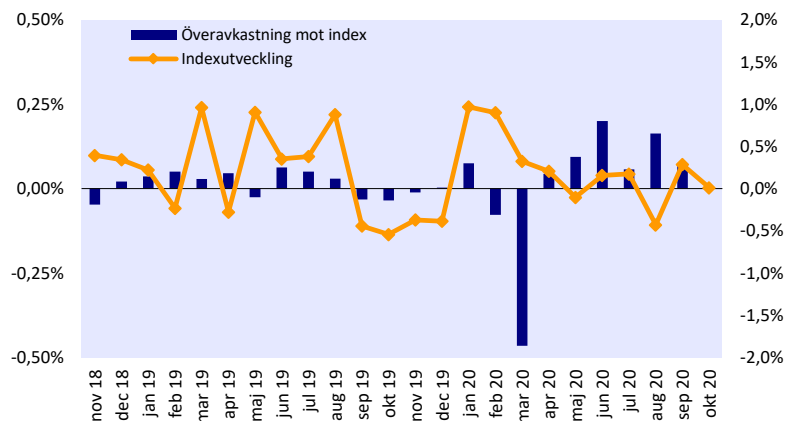
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

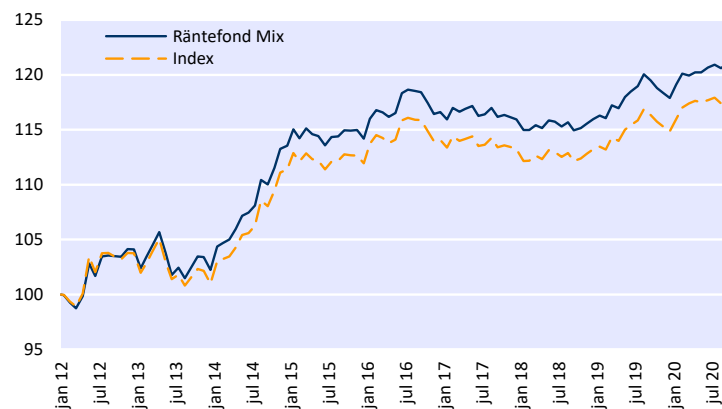
Överavkastning

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. |