

AMF Fonder AB - Månadsrapport

per 2022-05-31

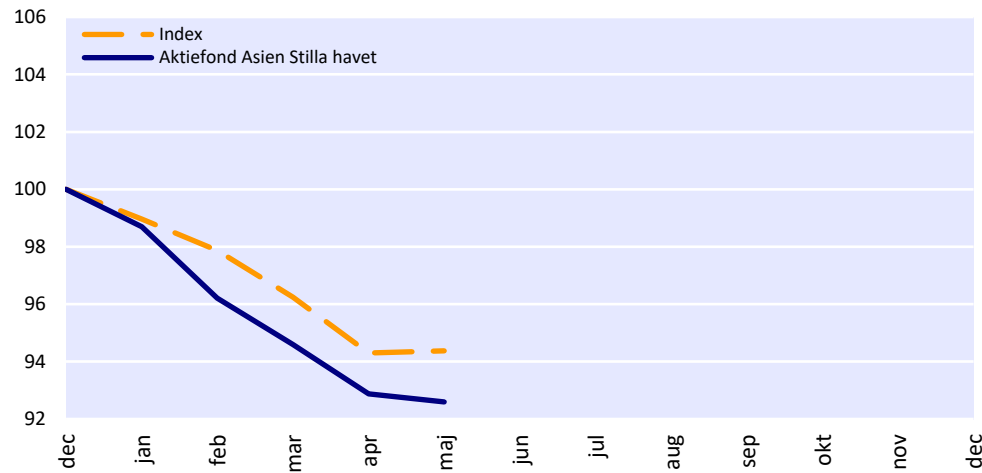


AMF Fonder AB, 113 88 Stockholm
Besöksadress: Klara Södra Kyrkogata 18
Telefon 08-696 31 00
www.amf.se
Org nr 556549-2922 Bolagets säte: Stockholm

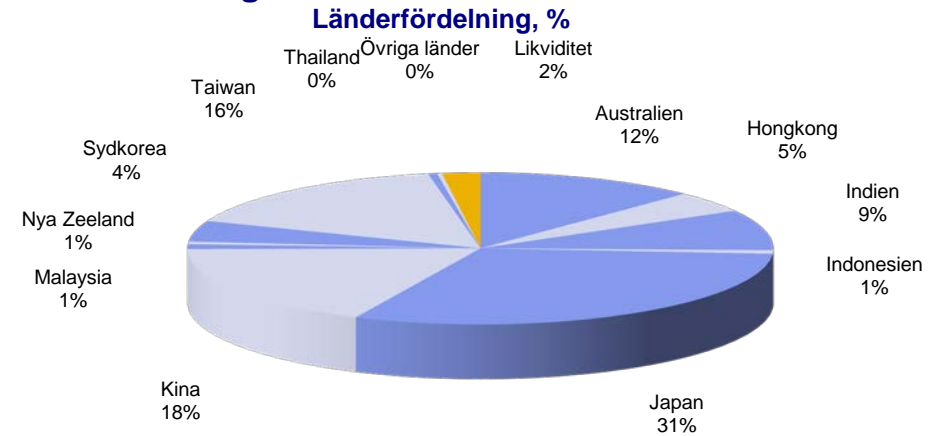
AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Asien och Stillahavsområdet.

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Asien Stilla havet



Aktiefond Asien Stilla havet	
Totalt antal andelar	6 497 123
Total förmögenhet MSEK	1 763,2
Likviditet *	2,1%
Avkastning från årets början	-7,40%
Avkastning Index	-5,62%
Nav-kurs	271,38

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	9,4
Alibaba Group Holding, Kina	4,7
Tencent Holdings, Kina	4,7
Reliance Industries, Indien	2,6
Commonwealth Bank of Australia,	2,5

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
AIA Group, Hong Kong	2,5
Shin-Etsu Chemical, Japan	2,2
Sony Group, Japan	2,1
Mediatek, Taiwan	2,1
Chailease Holding, Taiwan	2,0
Totalt	34,7

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

AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Perioden 170531-220531 (5 år)*	
Marknadsvärde (MSEK)	1 763,2

Avkastning - portfölj	50,6%
Avkastning - index	44,0%
Skillnad	6,6%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	12,0%
Volatilitet - index	12,0%
Aktiv risk	1,5%
Info. Kvot	0,63
Sharpekvot - portfölj	0,75
Jensens alfa	1,0%
Beta	0,99
Förklaringsgrad	98,3%
Konsistens	60,0%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	1 763,2	1 921,8	1 801,9	1 305,1	918,9	979,3	1 584,8

Avkastning - portfölj	-7,4%	8,9%	12,3%	28,3%	-5,6%	17,2%	11,1%
Avkastning - index	-5,6%	9,5%	6,4%	28,5%	-6,8%	17,6%	13,1%
Skillnad	-1,8%	-0,5%	5,9%	-0,2%	1,1%	-0,3%	-2,0%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-0,3%	-3,8%	-5,5%	-3,9%	29,3%	50,6%	8,3%
Avkastning - index	0,1%	-3,6%	-4,0%	-3,1%	24,5%	44,0%	8,7%
Skillnad	-0,4%	-0,2%	-1,5%	-0,8%	4,8%	6,6%	-0,4%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

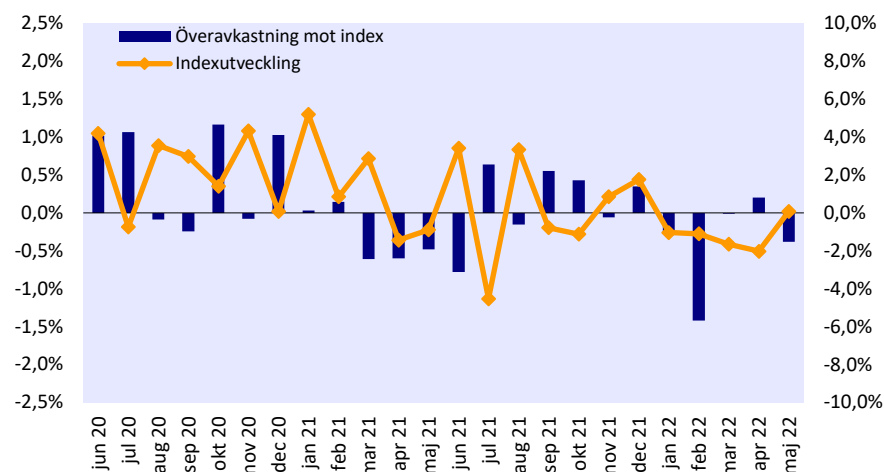
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

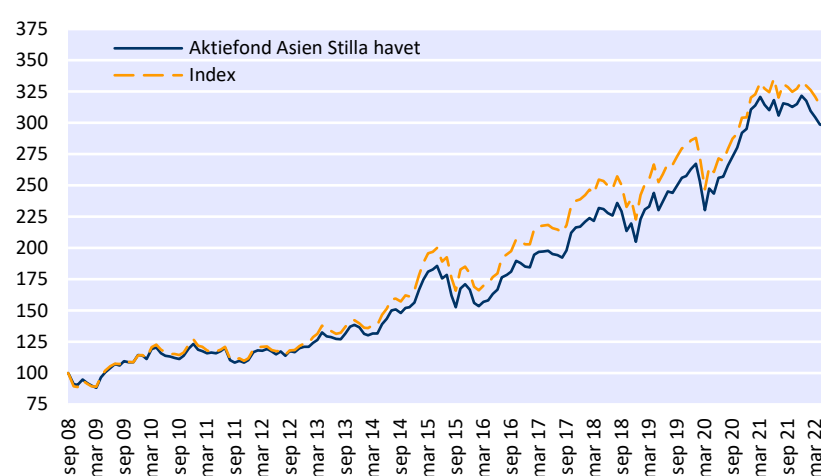
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



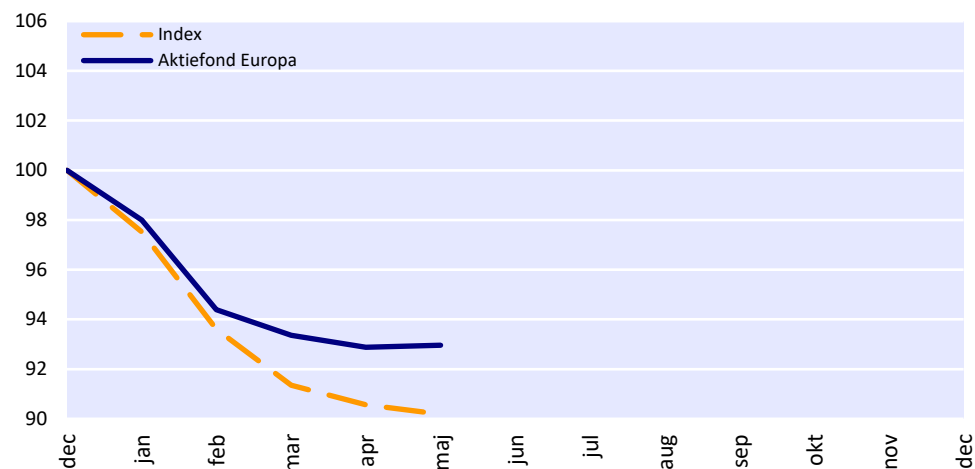
Utveckling fond vs index



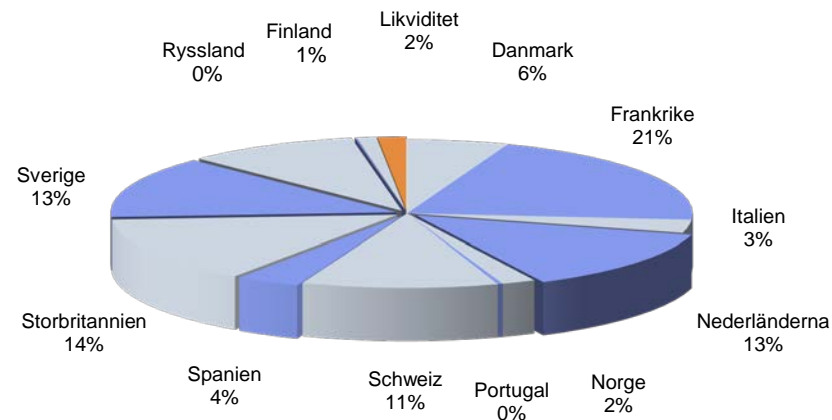
AMF AKTIEFOND EUROPA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Europa.

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Europa
Länderfördelning, %



Aktiefond Europa	
Totalt antal andelar	23 835 845
Total förmögenhet MSEK	6 305,4
Likviditet *	1,6%
Avkastning från årets början	-7,04%
Avkastning Index	-9,81%
Nav-kurs	264,53

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
AstraZeneca, Sverige	6,6
ASML, Nederländerna	4,8
Roche, Schweiz	4,4
Allianz, Tyskland	3,8
TotalEnergies, Frankrike	3,8

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Air Liquide, Frankrike	3,7
Novo Nordisk, Danmark	3,6
SAP, Tyskland	3,2
Enel, Italien	2,9
Lloyds Banking Group, Storbritannien	2,8
Totalt	39,5

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

AMF AKTIEFOND EUROPA

Perioden 170531-220531 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 6 305,4

Avkastning - portfölj 34,7%
 Avkastning - index 37,0%
 Skillnad -2,3%

Riskindikator 5
 Hållbarhetsbetyg 4
 Morningstar rating ** 5
 Volatilitet - portfölj 14,4%
 Volatilitet - index 14,2%
 Aktiv risk 2,6%
 Info. kvot -0,14
 Sharpekvot - portfölj 0,46
 Jensens alfa -0,4%
 Beta 1,00
 Förklaringsgrad 96,6%
 Konsistens 55,0%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	6 305,4	6 909,5	5 480,6	5 611,9	4 362,4	5 558,7	4 162,5

Avkastning - portfölj	-7,0%	23,1%	1,1%	29,6%	-8,9%	12,1%	7,0%
Avkastning - index	-9,8%	28,2%	-4,8%	32,5%	-6,2%	11,8%	5,6%
Skillnad	2,8%	-5,1%	5,9%	-2,8%	-2,7%	0,3%	1,4%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,1%	-1,5%	-1,6%	2,1%	28,5%	34,7%	6,1%
Avkastning - index	-0,4%	-3,7%	-4,2%	2,5%	25,5%	37,0%	4,6%
Skillnad	0,5%	2,1%	2,7%	-0,4%	3,0%	-2,3%	1,5%

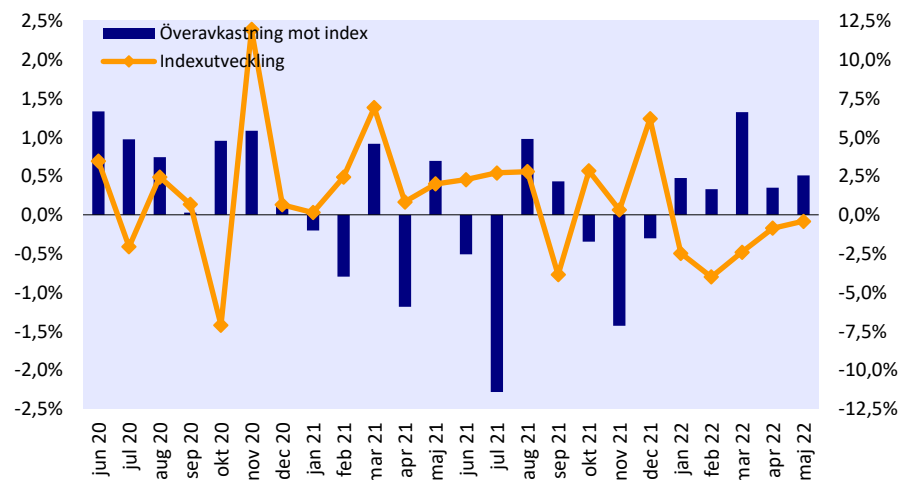
Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Europe NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

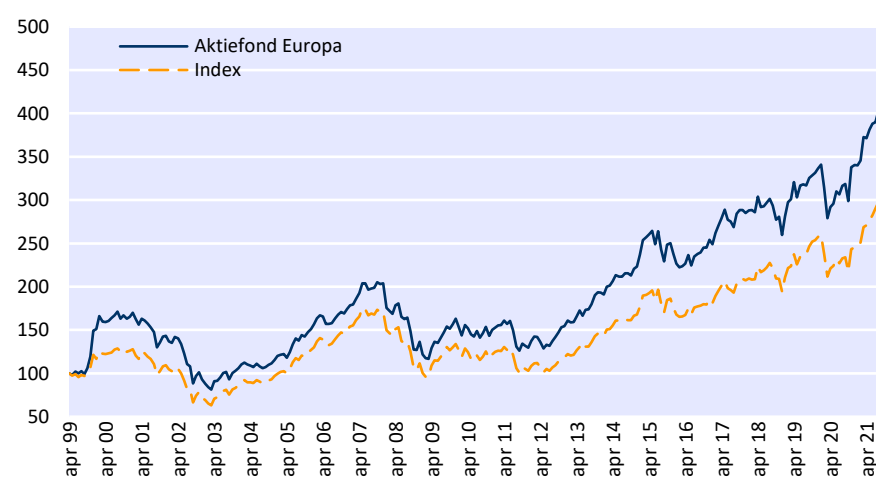
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



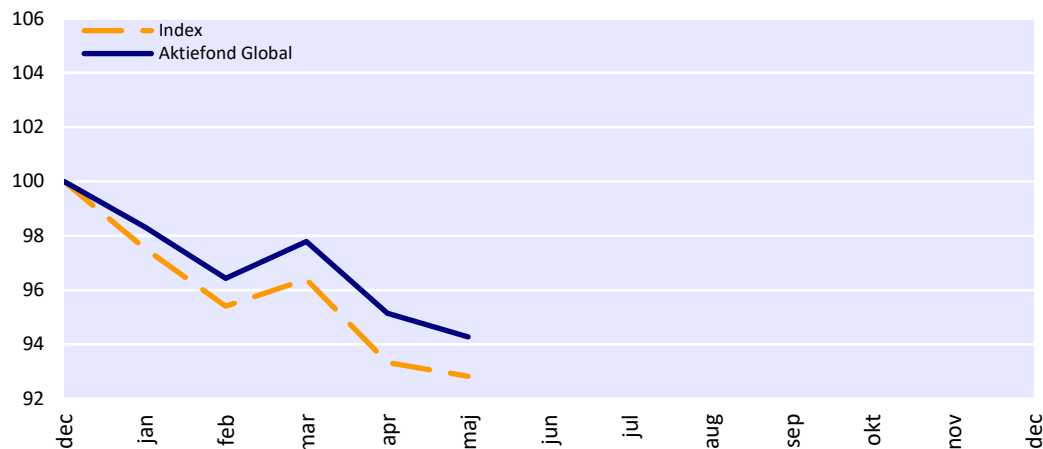
Utveckling fond vs index



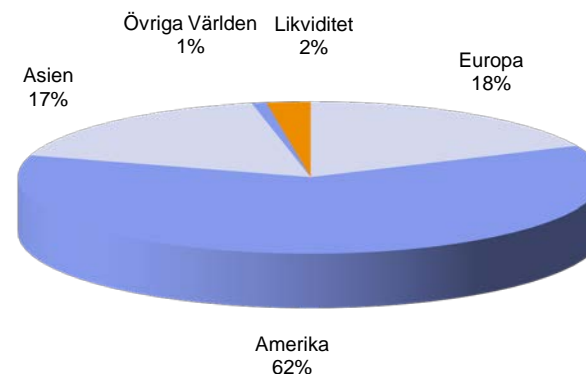
AMF AKTIEFOND GLOBAL

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
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Global
Länderfördelning, %



Aktiefond Global	
Totalt antal andelar	97 096 152
Total förmögenhet MSEK	26 902,5
Likviditet *	2,4%
Avkastning från årets början	-5,72%
Avkastning Index	-7,17%
Nav-kurs	277,07

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft, USA	7,7
Alphabet, USA	4,0
Procter & Gamble, USA	2,7
TotalEnergies, Frankrike	2,5
Coca-Cola, USA	2,4

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Berkshire Hathaway, USA	2,4
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	2,4
Visa, USA	2,3
Thermo Fischer Scientific, USA	2,1
Tesla, USA	2,1
Totalt	30,5

AMF AKTIEFOND GLOBAL

Perioden 170531-220531 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 26 902,5

Avkastning - portfölj 84,4%
 Avkastning - index 76,0%
 Skillnad 8,4%

Riskindikator 5
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating ** 5
 Volatilitet - portfölj 12,9%
 Volatilitet - index 13,6%
 Aktiv risk 1,7%
 Info. kvot 0,62
 Sharpekvot - portfölj 1,05
 Jensens alfa 1,8%
 Beta 0,94
 Förklaringsgrad 98,7%
 Konsistens 51,7%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	26 902,5	27 858,4	19 221,8	17 424,4	3 657,2	3 522,8	3 188,1
Avkastning - portfölj	-5,7%	33,3%	5,2%	34,7%	-1,1%	10,1%	15,6%
Avkastning - index	-7,2%	33,2%	1,8%	34,3%	-1,1%	10,9%	16,2%
Skillnad	1,5%	0,1%	3,5%	0,4%	0,0%	-0,8%	-0,6%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	26 902,5	27 858,4	19 221,8	17 424,4	3 657,2	3 522,8	3 188,1
Avkastning - portfölj	-5,7%	33,3%	5,2%	34,7%	-1,1%	10,1%	15,6%
Avkastning - index	-7,2%	33,2%	1,8%	34,3%	-1,1%	10,9%	16,2%
Skillnad	1,5%	0,1%	3,5%	0,4%	0,0%	-0,8%	-0,6%

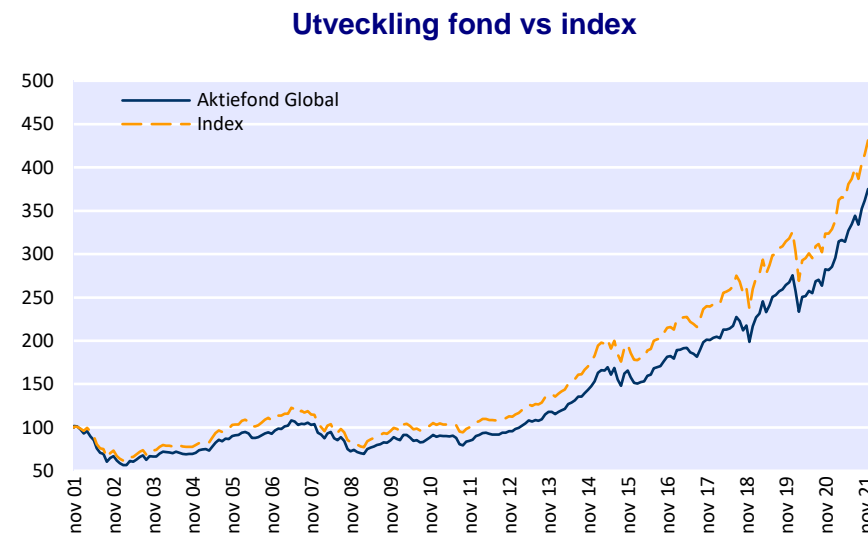
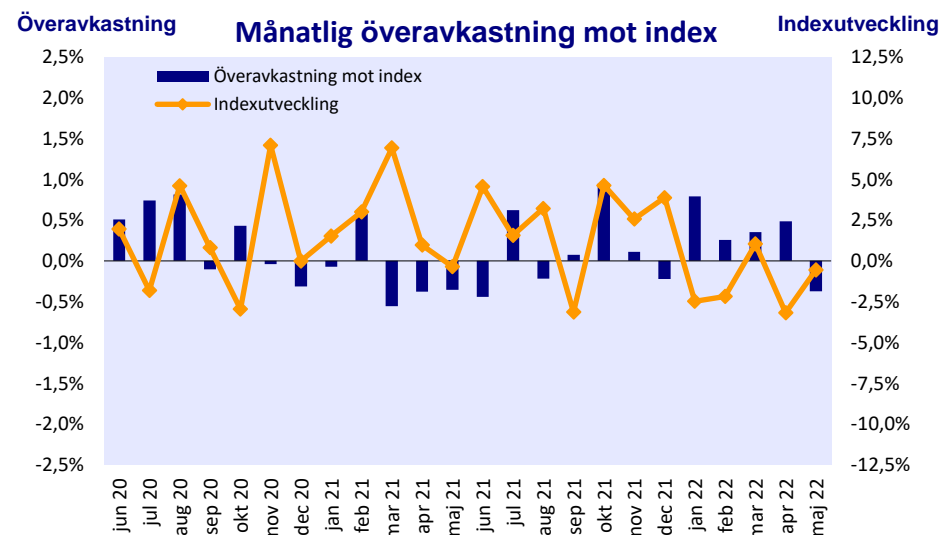
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-0,9%	-2,2%	-2,3%	12,5%	51,7%	84,4%	6,3%
Avkastning - index	-0,5%	-2,7%	-3,6%	9,9%	44,3%	76,0%	7,0%
Skillnad	-0,4%	0,5%	1,3%	2,7%	7,4%	8,4%	-0,6%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

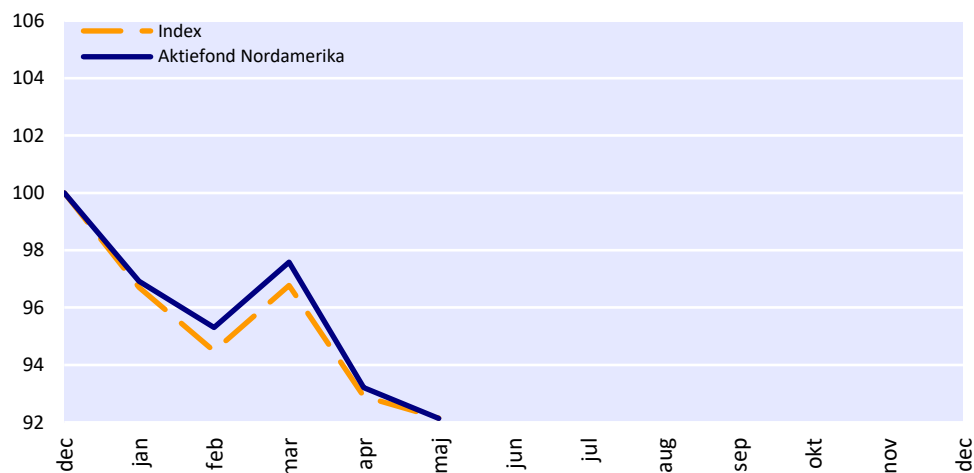
***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



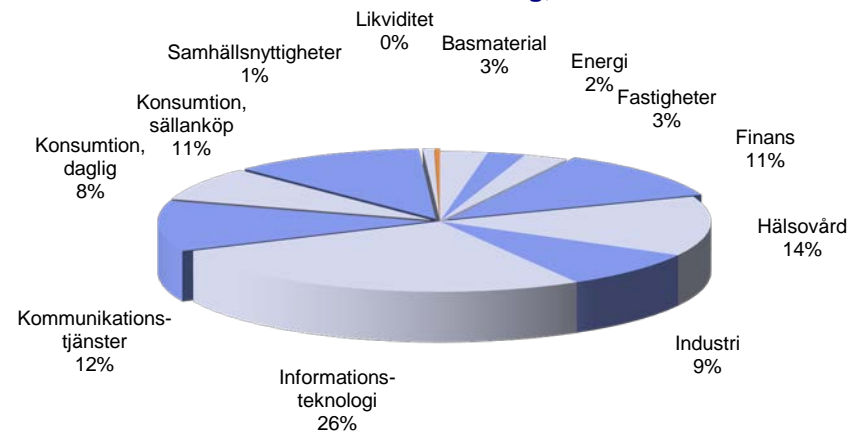
AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

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

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Nordamerika
branschfördelning, %



Aktiefond Nordamerika	
Totalt antal andelar	11 145 773
Total förmögenhet MSEK	4 987,3
Likviditet *	0,3%
Avkastning från årets början	-7,86%
Avkastning Index	-7,85%
Nav-kurs	447,47

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft	9,8
Alphabet	8,7
Procter & Gamble	3,5
Tesla	3,4
Visa	3,1

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Eli lilly & Company	3,0
Pepsi Co	3,0
Thermo Fischer Scientific	2,5
Nvidia	2,3
McDonald's	2,3
Totalt	41,5

AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

Perioden 170531-220531 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 4 987,3

Avkastning - portfölj 119,2%
 Avkastning - index 109,6%
 Skillnad 9,6%

Riskindikator 6
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating ** 5
 Volatilitet - portfölj 15,0%
 Volatilitet - index 15,2%
 Aktiv risk 1,6%
 Info. Kvot 0,64
 Sharpekvot - portfölj 1,17
 Jensens alfa 1,4%
 Beta 0,98
 Förklaringsgrad 98,8%
 Konsistens 51,7%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	4 987,3	5 265,0	2 761,4	2 826,5	1 808,6	1 528,3	1 751,1

Avkastning - portfölj	-7,9%	46,2%	6,2%	39,0%	5,3%	6,9%	18,7%
Avkastning - index	-7,9%	44,6%	3,7%	38,2%	4,3%	8,0%	19,6%
Skillnad	0,0%	1,6%	2,5%	0,7%	1,0%	-1,1%	-0,9%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-1,1%	-3,3%	-4,9%	17,3%	67,2%	119,2%	11,5%
Avkastning - index	-0,8%	-2,5%	-4,2%	16,5%	60,9%	109,6%	12,2%
Skillnad	-0,3%	-0,9%	-0,7%	0,8%	6,3%	9,6%	-0,7%

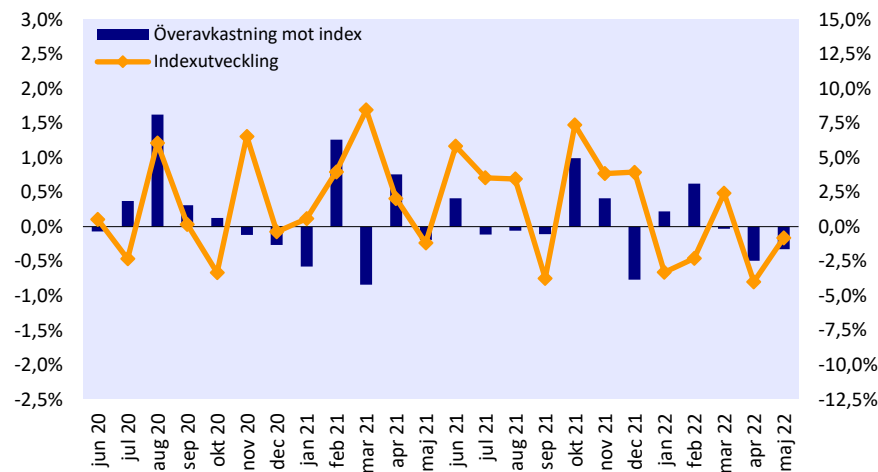
Referensindex: MSCI ESG Leaders USA NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

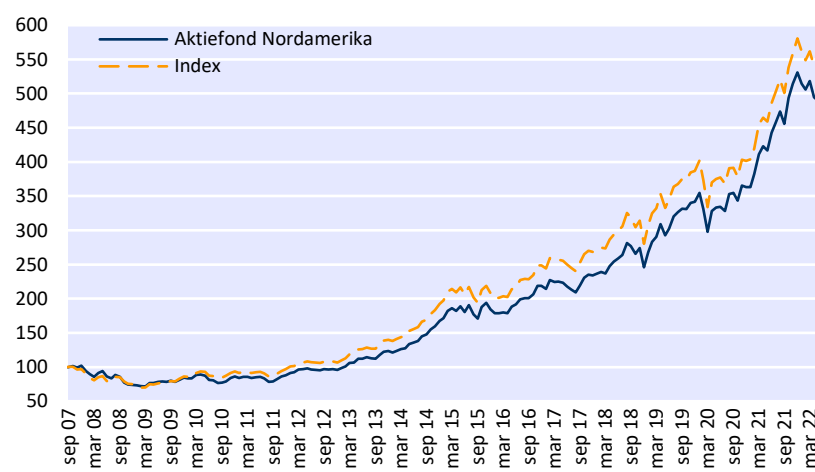
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



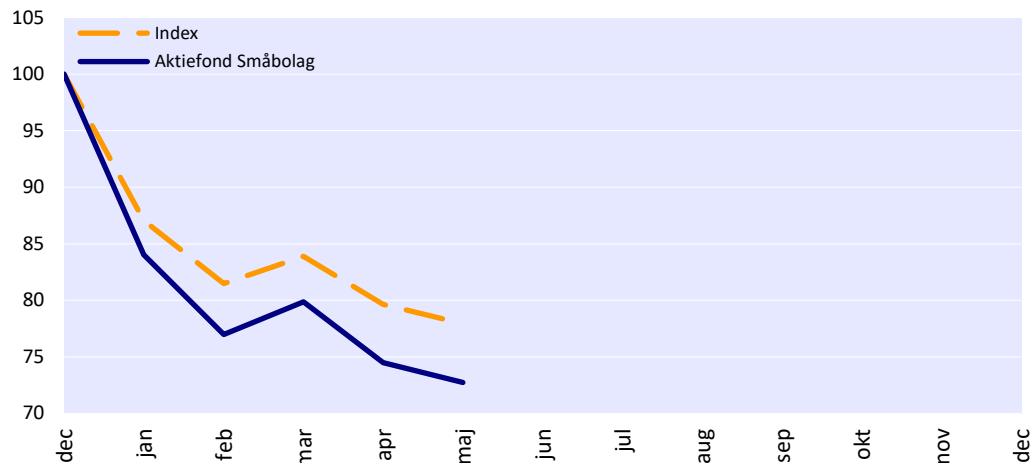
Utveckling fond vs index



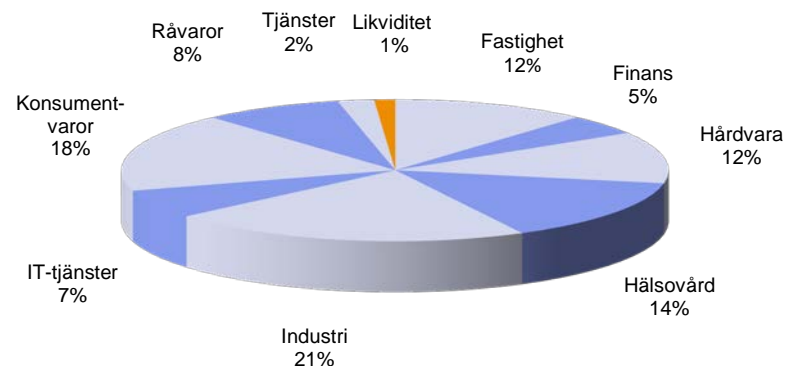
AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

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

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Småbolag
Branschfördelning, %



Aktiefond Småbolag	
Totalt antal andelar	15 888 541
Total förmögenhet MSEK	20 084,3
Likviditet *	1,2%
Avkastning från årets början	-27,27%
Avkastning index	-22,07%
Nav-kurs	1264,08

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Hexatronic Scandinavia	4,1
Beijer Ref	3,1
Avanza	3,0
Axfood	3,0
Addlife	3,0

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Trelleborg	2,9
SwedenCare	2,9
Boliden	2,8
Sweco	2,8
NCAB Group	2,6
	30,2

AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

Perioden 170531-220531 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	20 084,3
Avkastning - portfölj	102,6%
Avkastning - index	79,9%
Skillnad	22,8%
Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	20,7%
Volatilitet - index	19,7%
Aktiv risk	4,5%
Info. kvot	0,61
Sharpekvot - portfölj	0,76
Jensens alfa	2,3%
Beta	1,03
Förklaringsgrad	95,3%
Konsistens	60,0%

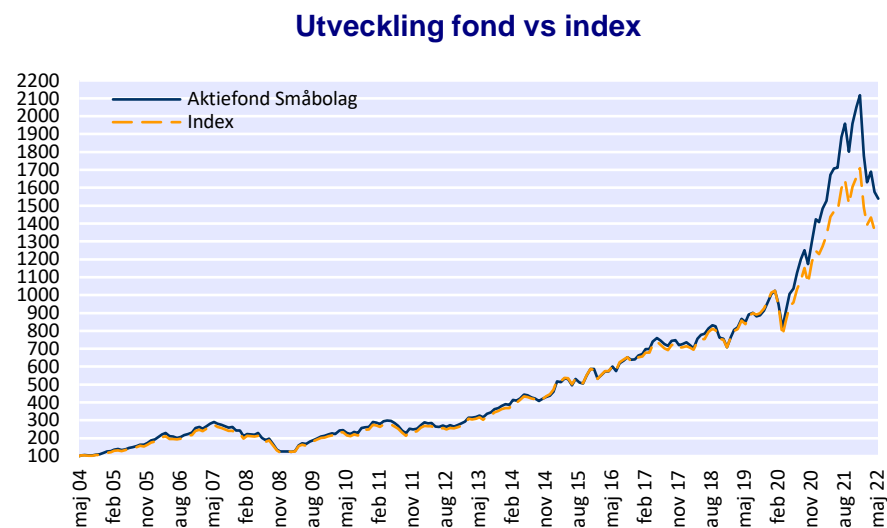
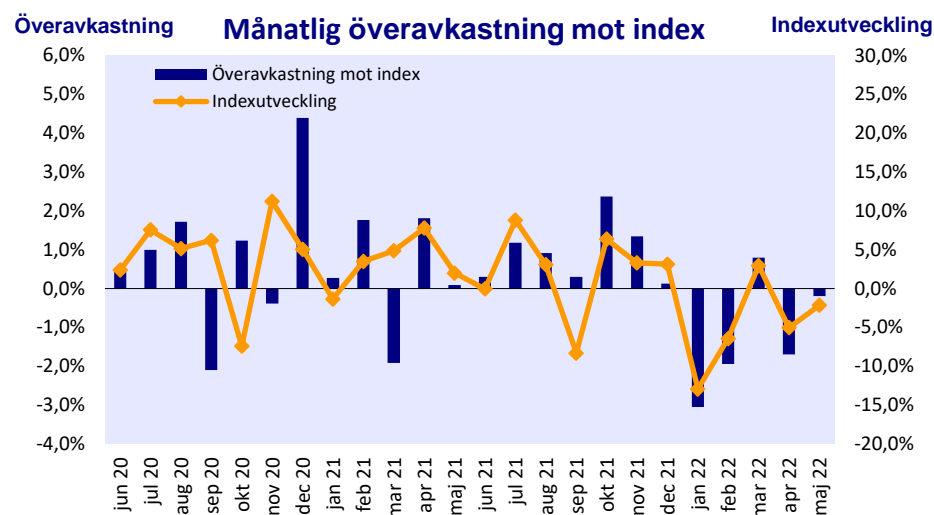
	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	20 084,3	29 223,5	16 069,7	9 803,5	6 723,3	7 358,6	6 492,9
Avkastning - portfölj	-27,3%	48,7%	41,5%	42,2%	-2,6%	9,6%	13,0%
Avkastning - index	-22,1%	37,1%	23,0%	43,2%	-0,2%	8,8%	12,2%
Skillnad	-5,2%	11,5%	18,5%	-1,0%	-2,4%	0,8%	0,9%
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-2,3%	-5,5%	-24,9%	-9,8%	81,5%	102,6%	16,4%
Avkastning - index	-2,2%	-4,3%	-19,6%	-9,2%	58,9%	79,9%	15,4%
Skillnad	-0,2%	-1,2%	-5,3%	-0,6%	22,6%	22,8%	0,9%

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

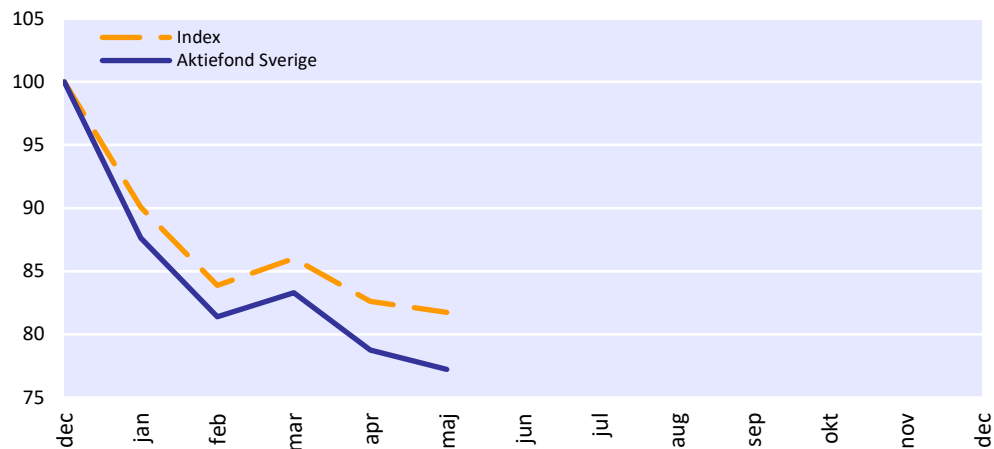
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



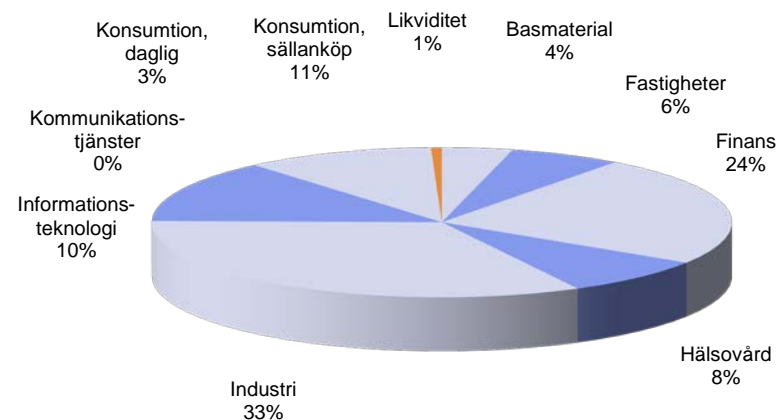
AMF AKTIEFOND SVERIGE

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

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Sverige
Branschfördelning, %



Aktiefond Sverige	
Totalt antal andelar	48 971 655
Total förmögenhet MSEK	39 032,4
Likviditet *	0,6%
Avkastning från årets början	-22,77%
Avkastning Index	-18,25%
Nav-kurs	797,04

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: SIXPRX

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Epiroc	4,1
Indutrade	4,0
Ericsson	3,3
Essity	3,2
Latour	3,1
Totalt	48,9

AMF AKTIEFOND SVERIGE

Perioden 170531-220531 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK)	39 032,4
Avkastning - portfölj	39,5%
Avkastning - index	63,7%
Skillnad	-24,2%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	2
Volatilitet - portfölj	17,5%
Volatilitet - index	16,9%
Aktiv risk	2,2%
Info. kvot	-1,58
Sharpekvot - portfölj	0,42
Jensens alfa	-3,7%
Beta	1,02
Förklaringsgrad	98,5%
Konsistens	31,7%

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

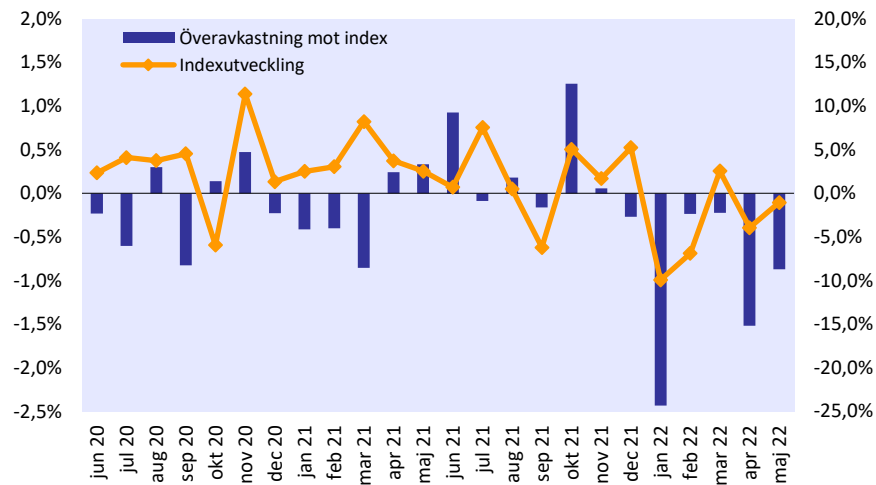
	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	39 032,4	50 893,7	37 056,3	33 846,3	25 371,6	27 691,6	27 500,3

Avkastning - portfölj	-22,8%	40,5%	11,7%	25,7%	-4,9%	7,9%	8,6%
Avkastning - index	-18,3%	39,3%	14,8%	35,0%	-4,6%	10,0%	9,2%
Skillnad	-4,5%	1,1%	-3,1%	-9,3%	-0,2%	-2,2%	-0,5%

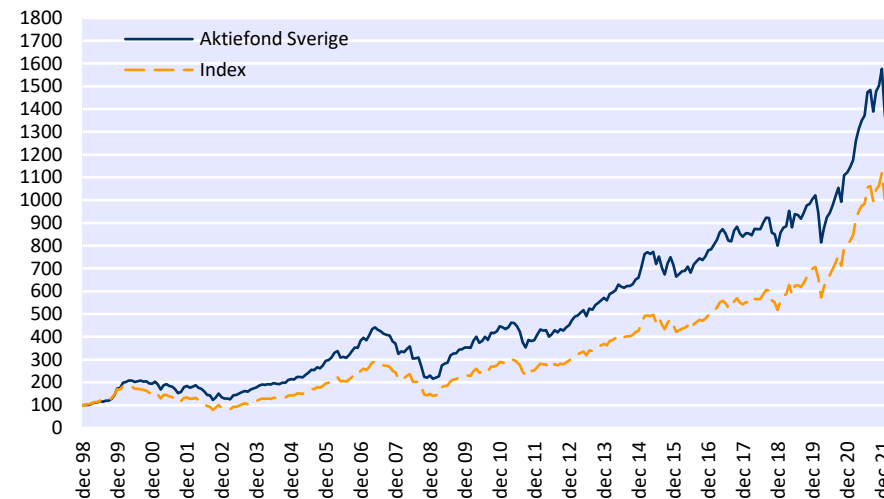
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-1,9%	-5,1%	-18,9%	-9,8%	38,4%	39,5%	11,3%
Avkastning - index	-1,1%	-2,5%	-14,0%	-6,3%	56,2%	63,7%	9,9%
Skillnad	-0,9%	-2,6%	-5,0%	-3,5%	-17,9%	-24,2%	1,4%

Referensindex: SIXPRX

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



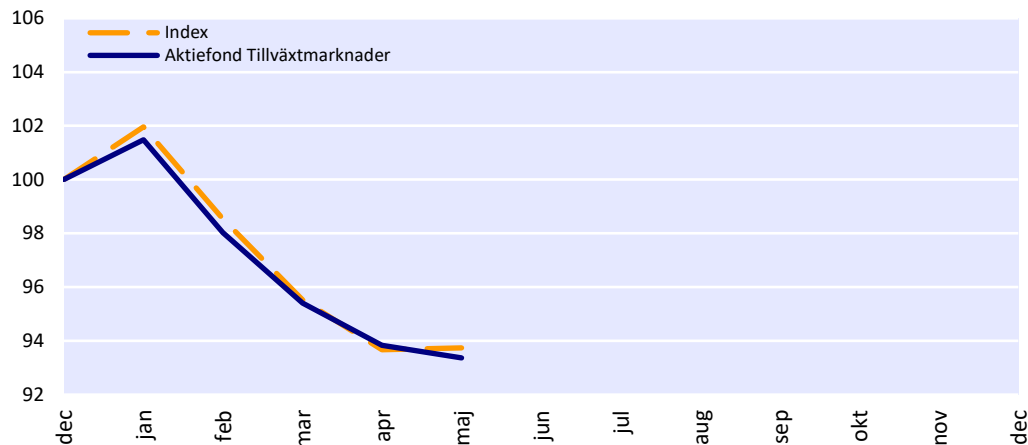
Utveckling fond vs index



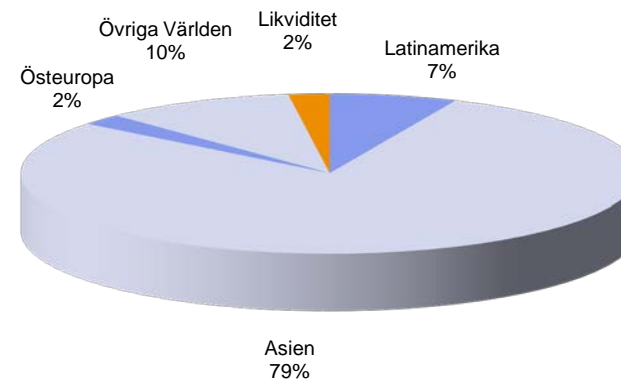
AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

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

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Tillväxtmarknader
Regionfördelning, %



Aktiefond Tillväxtmarknader	
Totalt antal andelar	17 279 887
Total förmögenhet MSEK	1 938,7
Likviditet *	2,1%
Avkastning från årets början	-6,63%
Avkastning Index	-6,25%
Nav-kurs	112,20

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	9,6
Tencent Holdings, Kina	6,9
Alibaba Group Holding, Kina	6,4
Reliance Industries, Indien	4,2
Mediatek, Taiwan	2,4

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Meituan Dianping, Kina	2,4
China Construct. Bank, Kina	2,1
Infosys, Indien	2,1
Chailease Holding, Taiwan	2,0
Housing Dev. Finance, Indien	1,6
	39,7

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

AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

Perioden 191211-220531 ^{1),2)}	
Marknadsvärde (MSEK)	1 938,7
Avkastning - portfölj	12,2%
Avkastning - index	11,4%
<i>Skillnad</i>	0,8%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating	-
Volatilitet - portfölj ³⁾	14,4%
Volatilitet - index ³⁾	14,2%
Aktiv risk ²⁾	2,0%
Info. Kvot ²⁾	0,16
Sharpekvot - portfölj ²⁾	0,37
Jensens alfa ²⁾	0,2%
Beta ²⁾	1,02
Förklaringsgrad ²⁾	98,5%
Konsistens ²⁾	50,0%

	2022	2021	2020	2019
Marknadsvärde (MSEK)	1 938,7	2 026,9	1 653,4	322,2
Avkastning - portfölj	-6,6%	6,7%	7,9%	4,4%
Avkastning - index	-6,3%	8,0%	5,4%	4,5%
<i>Skillnad</i>	-0,4%	-1,3%	2,5%	-0,1%

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

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

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

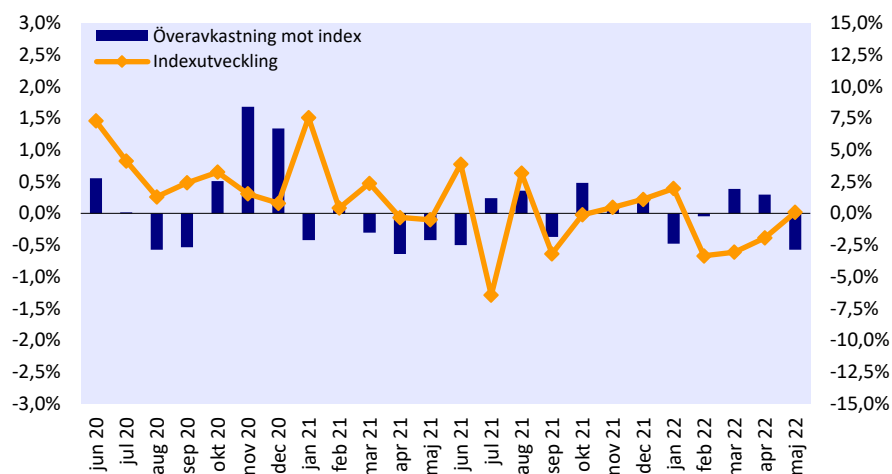
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

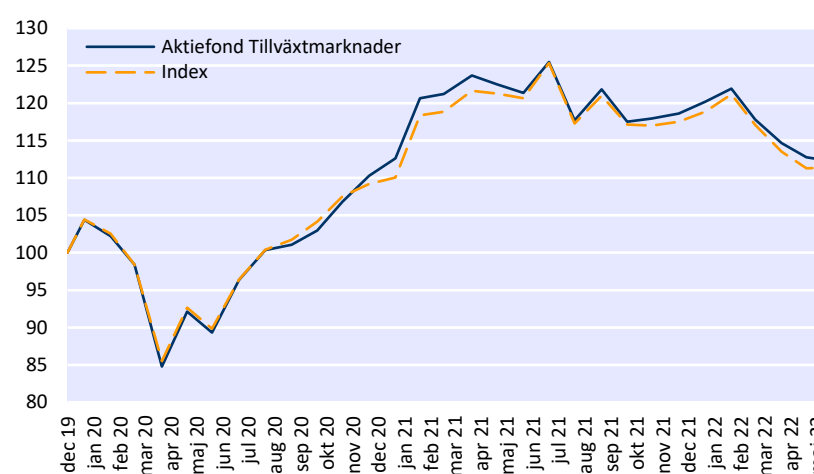
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



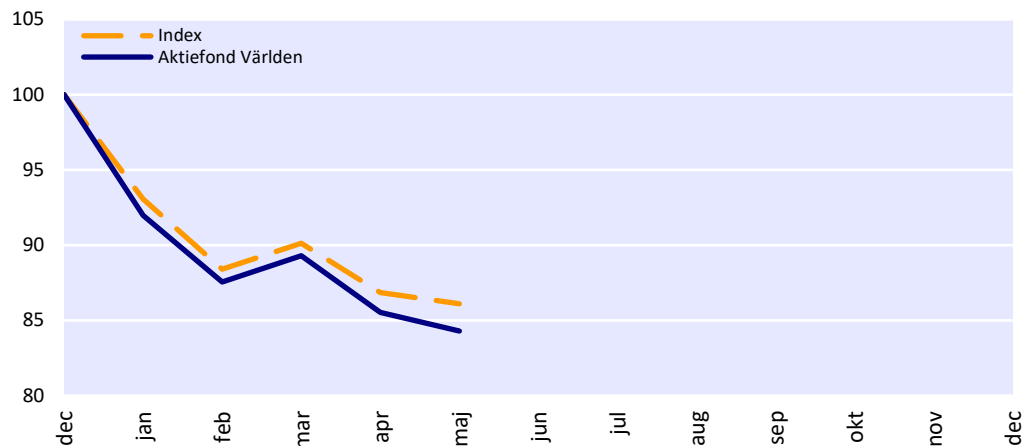
Utveckling fond vs index



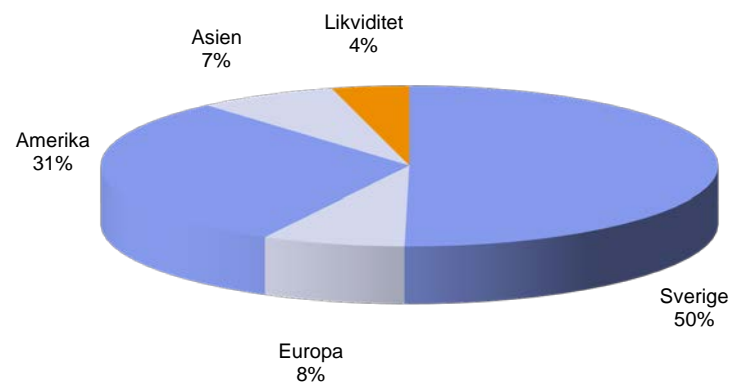
AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

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

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Aktiefond Världen
Regionfördelning, %



Aktiefond Världen	
Totalt antal andelar	81 516 582
Total förmögenhet MSEK	45 642,6
Likviditet *	4,1%
Avkastning från årets början	-15,71%
Avkastning Index	-13,89%
Nav-kurs	559,92

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	4,8
Microsoft, USA	3,4
SEB	3,0
Volvo	2,9
Atlas Copco	2,4

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Hexagon	2,2
Indutrade	2,1
Alphabet, USA	2,0
Epiroc	2,0
AstraZeneca	1,9
	26,7

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

AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

Perioden 170531-220531 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	45 642,6

Avkastning - portfölj	53,0%
Avkastning - index	69,3%
Skillnad	-16,4%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	2
Volatilitet - portfölj	15,1%
Volatilitet - index	15,0%
Aktiv risk	1,5%
Info. kvot	-1,48
Sharpekvot - portfölj	0,62
Jensens alfa	-2,2%
Beta	1,00
Förklaringsgrad	99,0%
Konsistens	36,7%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	45 642,6	54 930,0	41 075,8	39 160,8	31 486,5	33 731,8	32 024,0

Avkastning - portfölj	-15,7%	37,3%	8,0%	28,3%	-3,7%	8,1%	11,6%
Avkastning - index	-13,9%	37,0%	9,6%	34,8%	-3,2%	10,5%	12,0%
Skillnad	-1,8%	0,3%	-1,5%	-6,5%	-0,5%	-2,4%	-0,4%

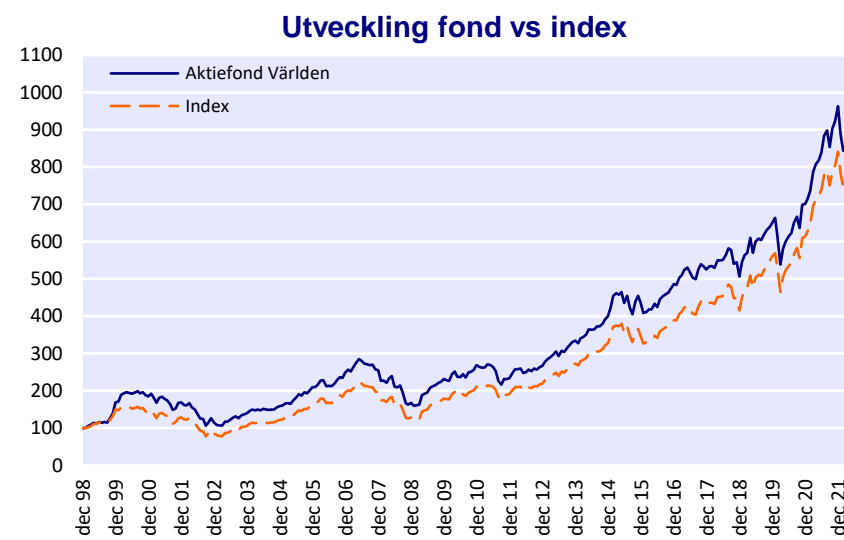
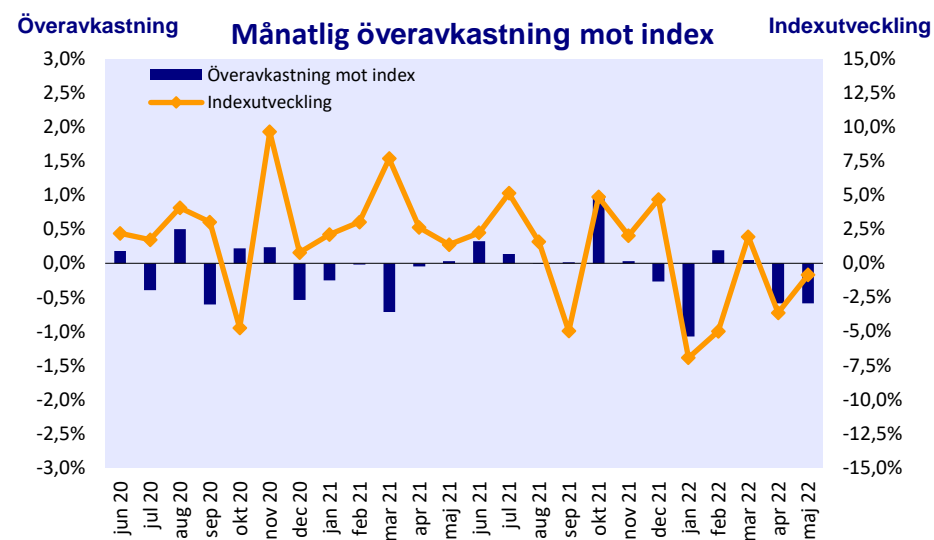
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-1,4%	-3,7%	-12,0%	-0,9%	42,5%	53,0%	9,4%
Avkastning - index	-0,9%	-2,6%	-9,9%	0,1%	51,9%	69,3%	8,8%
Skillnad	-0,6%	-1,1%	-2,1%	-0,9%	-9,4%	-16,4%	0,5%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

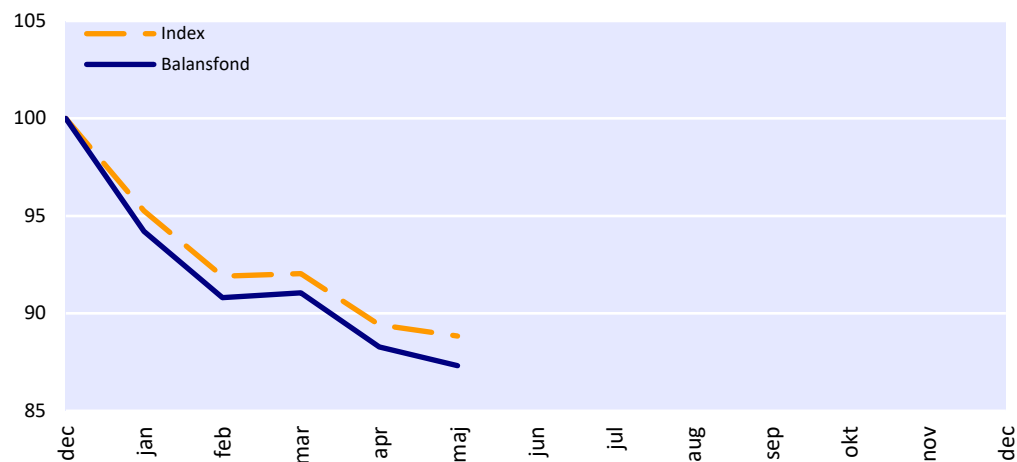
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



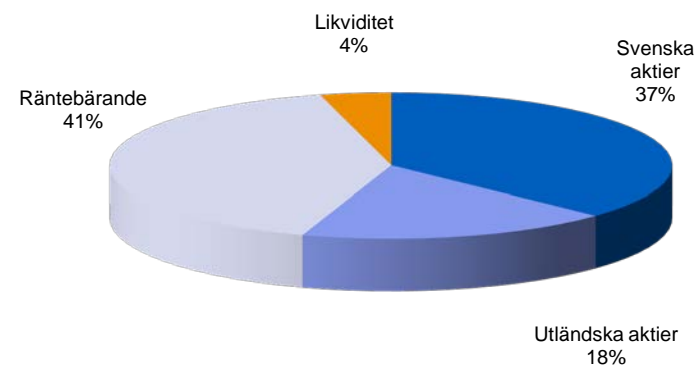
AMF BALANSFOND

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
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Balansfond
fördelning aktier/räntebärande, %



Balansfond	
Totalt antal andelar	72 484 207
Total förmögenhet MSEK	25 391,8
Likviditet *	4,1%
Modifierad duration	3,46%
Avkastning från årets början	-12,68%
Avkastning Index	-11,16%
Nav-kurs	350,31

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	3,6
SEB	2,2
Volvo	2,2
Atlas Copco	1,8
Hexagon	1,6
	11,5

Största ränteb. Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	6,2
SBAB	3,9
Hexagon	3,8
SEB Bolån	3,6
LF Hypotek	2,3
	19,7

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

AMF BALANSFOND

Perioden 170531-220531 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 25 391,8

Avkastning - portfölj 28,6%
 Avkastning - index 36,6%
 Skillnad -8,0%

Riskindikator 4
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating ** 5
 Volatilitet - portfölj 9,8%
 Volatilitet - index 9,3%
 Aktiv risk 1,1%
 Info. kvot -1,13
 Sharpekvot - portfölj 0,58
 Jensens alfa -1,6%
 Beta 1,05
 Förklaringsgrad 98,8%
 Konsistens 36,7%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	25 391,8	29 242,7	23 820,1	23 265,8	20 513,5	21 734,7	21 288,0

Avkastning - portfölj	-12,7%	22,4%	6,0%	16,9%	-1,9%	5,2%	8,3%
Avkastning - index	-11,2%	20,8%	7,3%	20,5%	-1,5%	6,4%	8,1%
Skillnad	-1,5%	1,6%	-1,3%	-3,7%	-0,5%	-1,2%	0,1%

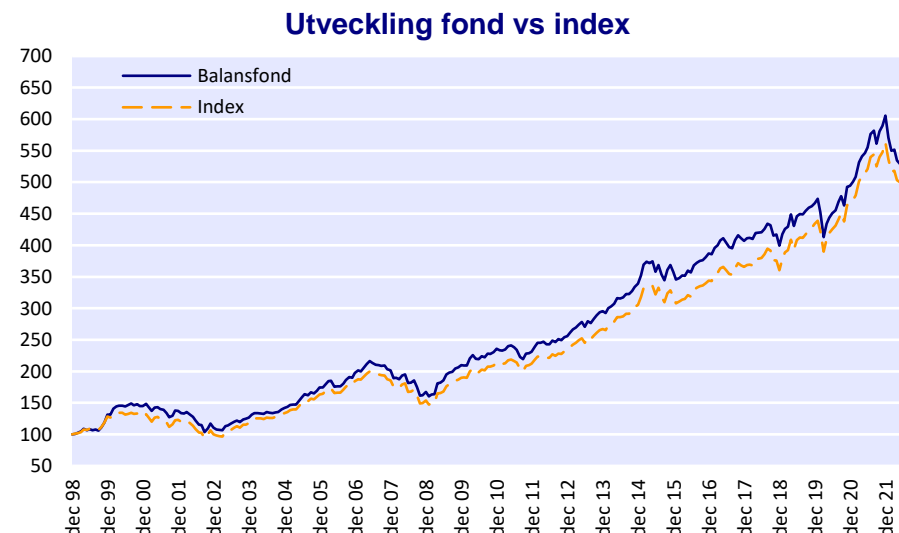
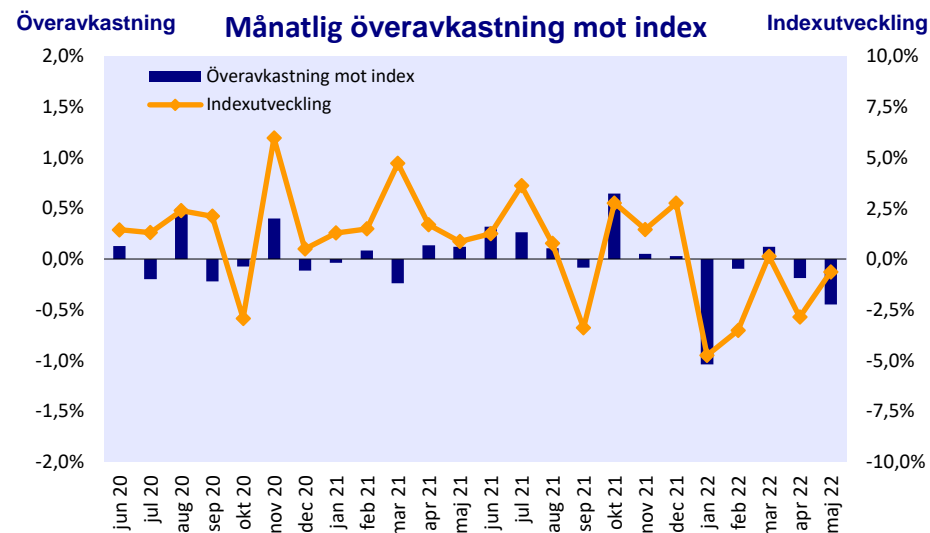
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-1,1%	-3,8%	-10,3%	-3,2%	22,7%	28,6%	7,4%
Avkastning - index	-0,6%	-3,3%	-8,7%	-2,8%	27,0%	36,6%	7,1%
Skillnad	-0,4%	-0,5%	-1,5%	-0,4%	-4,3%	-8,0%	0,3%

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

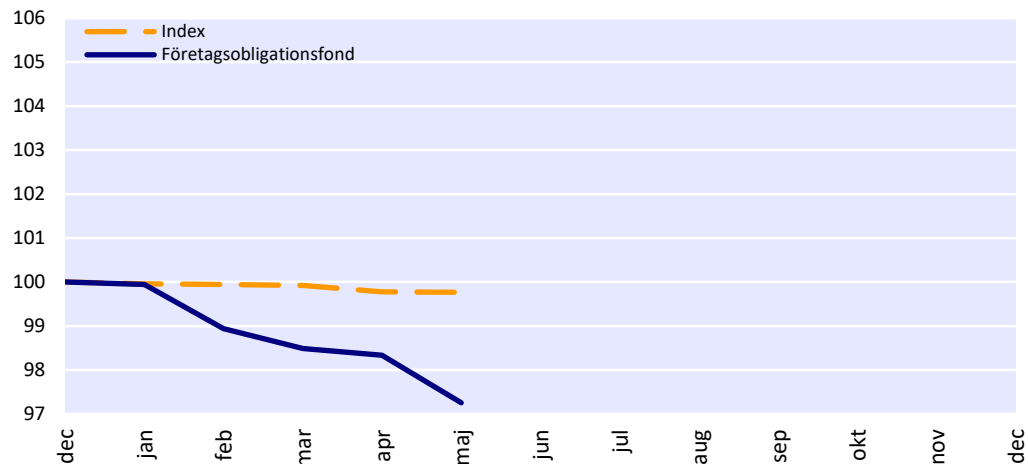
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



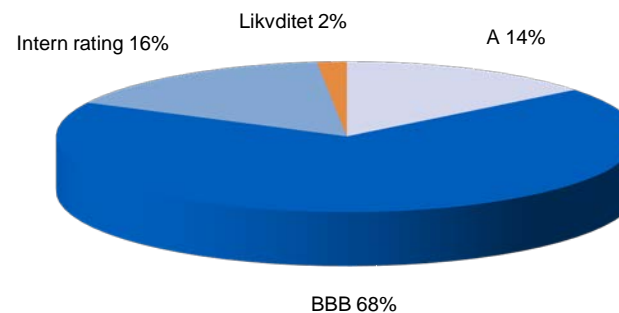
AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

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
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Företagsobligationsfond
Rating, %



Företagsobligationsfond	
Totalt antal andelar	8 350 178
Total förmögenhet MSEK	833,8
Likviditet *	1,7%
Duration	0,70
Modifierad duration	0,69%
Modifierad duration krediter	0,69%
Yield	2,00%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	2,68
Avkastning från årets början	-2,75%
Avkastning index	-0,23%
Nav-kurs	99,85

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Hexagon	8,7
Atrium Ljungberg	8,1
Klarna Bank	7,2
Castellum	6,5
Svensk Fastighetsfinansiering	5,3
	35,9

AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

Perioden 180829-220531 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK) 833,8

Avkastning - portfölj -0,15%

Avkastning - index -1,44%

Skillnad 1,29%

Riskindikator ³⁾ 2

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating 3

Volatilitet - portfölj ³⁾ 1,9%

Volatilitet - index ³⁾ 0,1%

Aktiv risk ²⁾ 2,2%

Info. Kvot ²⁾ 0,16

Sharpekvot - portfölj ²⁾ 0,23

Jensens alfa ²⁾ 0,3%

Beta ²⁾ 1,39

Förklaringsgrad ²⁾ 0,4%

Konsistens ²⁾ 68,9%

	2022	2021	2020	2019	2018
--	------	------	------	------	------

Marknadsvärde (MSEK) 833,8 930,6 700,1 641,8 536,5

Avkastning - portfölj -2,75% 0,92% 0,99% 1,60% -0,86%

Avkastning - index -0,23% -0,21% -0,17% -0,53% -0,30%

Skillnad -2,51% 1,14% 1,17% 2,13% -0,56%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	Start ⁴⁾
--	-------	-------	-------	------	------	---------------------

Avkastning - portfölj -1,10% -1,70% -2,64% -2,51% -0,19% -0,04%

Avkastning - index -0,01% -0,17% -0,28% -0,36% -0,93% -0,39%

Skillnad -1,09% -1,53% -2,36% -2,15% 0,74% 0,35%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

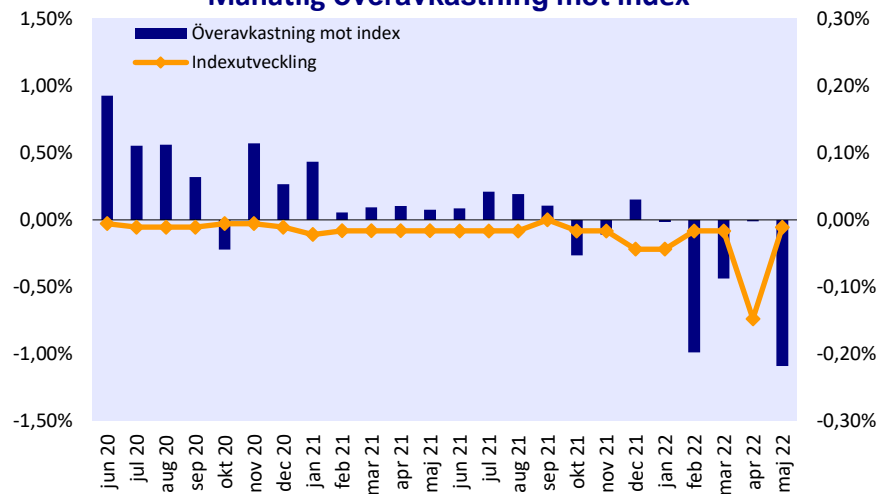
¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

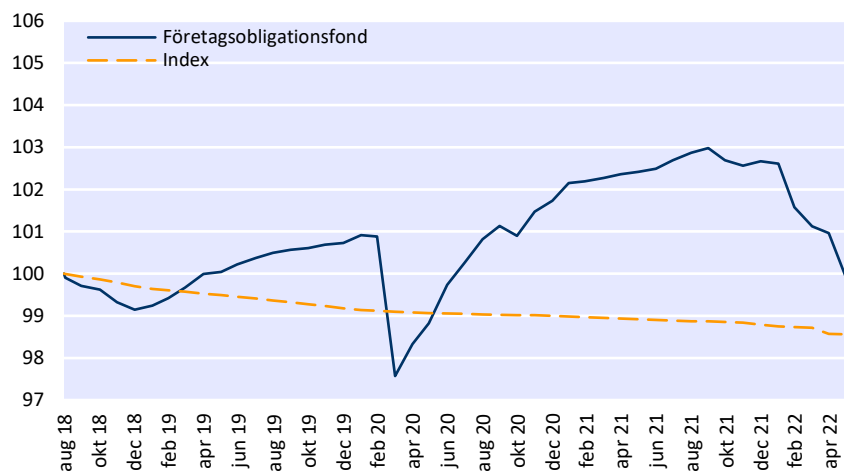
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



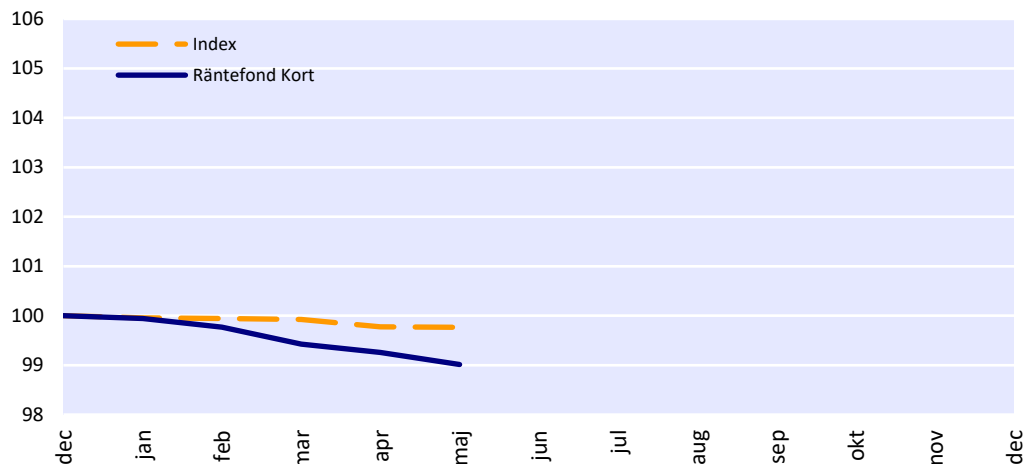
Utveckling fond vs index



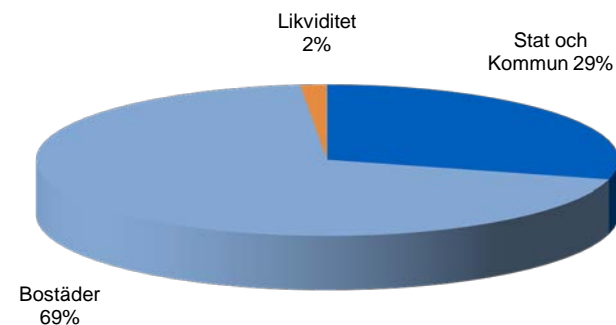
AMF RÄNTEFOND KORT

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

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Råntefond Kort
Emittentfördelning, %



Råntefond Kort	
Totalt antal andelar	67 245 908
Total förmögenhet MSEK	7 422,2
Likviditet *	1,5%
Duration	0,51
Modifierad duration	0,51%
Modifierad duration krediter	0,64%
Yield	0,91%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	1,73
Avkastning från årets början	-0,99%
Avkastning index	-0,23%
Nav-kurs	110,37

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Kommuninvest	17,2
Skandiabanken	11,9
Landshypotek	11,4
Nykredit	11,2
LF Hypotek	7,1
	58,9

AMF RÄNTEFOND KORT

Perioden 170531-220531 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 7 422,2

Avkastning - portfölj -1,74%

Avkastning - index -2,38%

Skillnad 0,63%

Riskindikator 1

Hållbarhetsbetyg 4

Morningstar rating ** -

Volatilitet - portfölj 0,3%

Volatilitet - index 0,1%

Aktiv risk 0,3%

Info. kvot 0,49

Sharpekvot - portfölj 0,48

Jensens alfa 0,1%

Beta 0,58

Förklaringsgrad 4,4%

Konsistens 78,3%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	7 422,2	6 399,0	5 582,1	4 443,6	5 252,2	4 834,0	5 384,6

Avkastning - portfölj -0,99%

Avkastning - index -0,23%

Skillnad -0,75%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-0,24%	-0,76%	-0,99%	-1,02%	-0,99%	-1,74%	1,39%
Avkastning - index	-0,01%	-0,17%	-0,28%	-0,36%	-0,93%	-2,38%	0,80%
Skillnad	-0,23%	-0,58%	-0,71%	-0,66%	-0,05%	0,63%	0,59%

Avkastning - portfölj -0,99%

Avkastning - index -0,01%

Skillnad -0,23%

Skillnad -0,58%

Skillnad -0,71%

Skillnad -0,66%

Skillnad -0,05%

Skillnad 0,63%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

Skillnad 0,59%

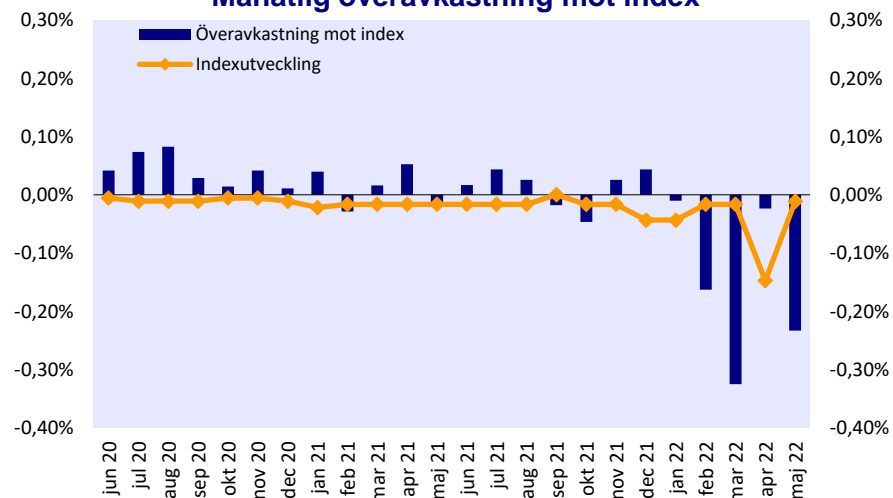
Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

* Alla värden beräknas inkl avgifter

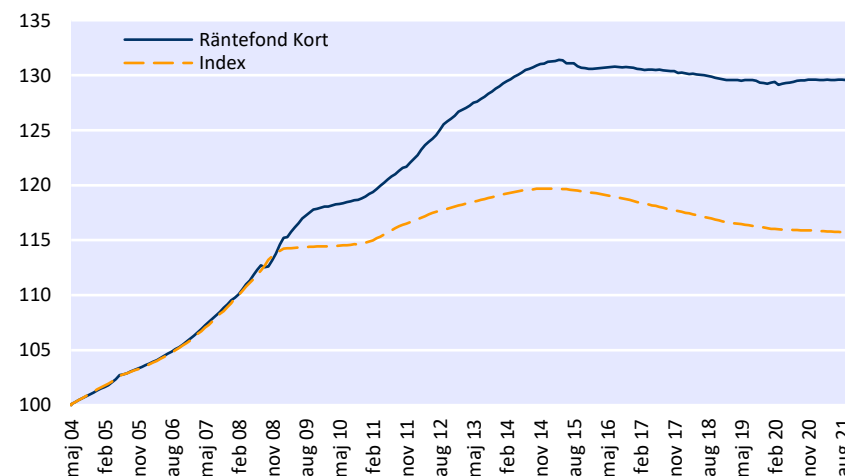
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



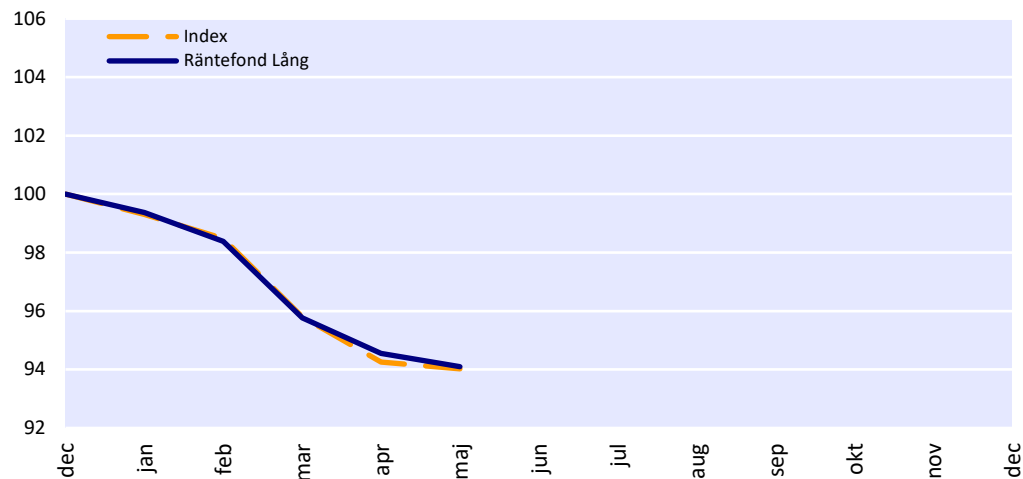
Utveckling fond vs index



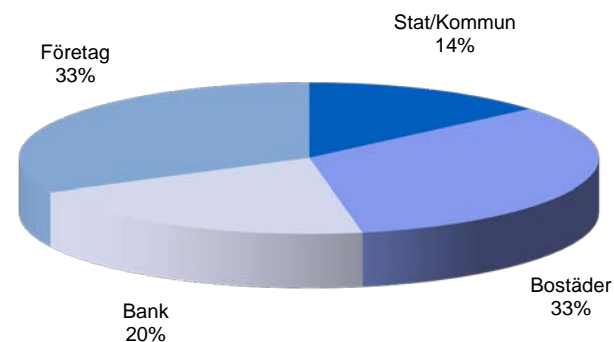
AMF RÄNTEFOND LÅNG

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

Utveckling
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Råntefond Lång
Emittentfördelning, %



Råntefond Lång

Totalt antal andelar	55 276 856
Total förmögenhet MSEK	7 869,4
Likviditet *	-10,5%
Duration	3,70
Modifierad duration	3,62%
Modifierad duration krediter	2,29%
Yield	2,06%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	3,73
Avkastning från årets början	-5,90%
Avkastning Index	-5,98%
Nav-kurs	142,36

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	15,2
SBAB	10,3
SEB Bolån	9,8
LF Hypotek	6,9
Castellum	6,0
Totalt	48,3

AMF RÄNTEFOND LÅNG

Perioden 170531-220531 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 7 869,4

Avkastning - portfölj -1,8%

Avkastning - index -3,7%

Skillnad 1,9%

Riskindikator 2

Hållbarhetsbetyg 4

Morningstar rating ** 5

Volatilitet - portfölj 2,2%

Volatilitet - index 2,0%

Aktiv risk 0,7%

Info. kvot 0,55

Sharpekvot - portfölj 0,06

Jensens alfa 0,4%

Beta 1,02

Förklaringsgrad 89,6%

Konsistens 80,0%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	7 869,4	9 008,9	8 859,8	8 621,8	8 077,9	6 970,1	7 328,8

Avkastning - portfölj -5,9%

Avkastning - index -6,0%

Skillnad 0,1%

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

Avkastning - portfölj -4,4%

Avkastning - index -4,5%

Skillnad 0,2%

Skillnad 0,1%

Skillnad 0,2%

Skillnad 0,3%

Skillnad 1,5%

Skillnad 1,9%

Skillnad 0,2%

Skillnad 0,2%

Skillnad 0,2%

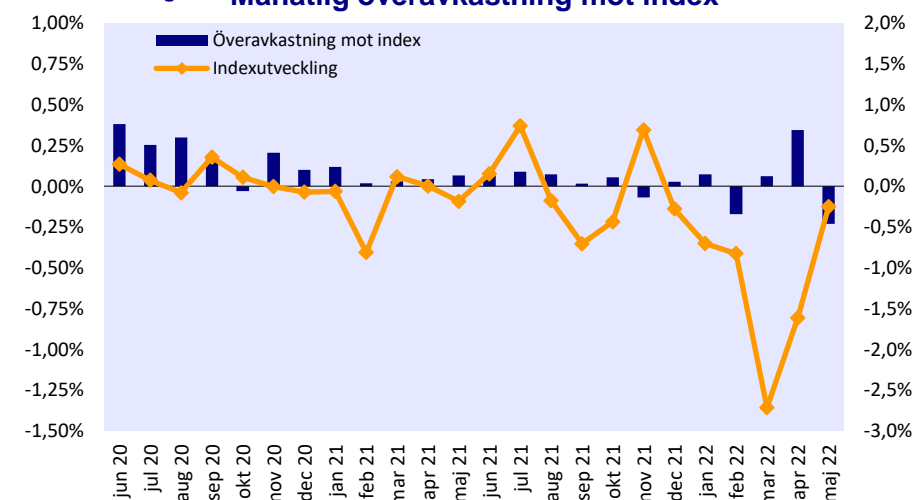
Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

* Alla värden beräknas inkl avgifter

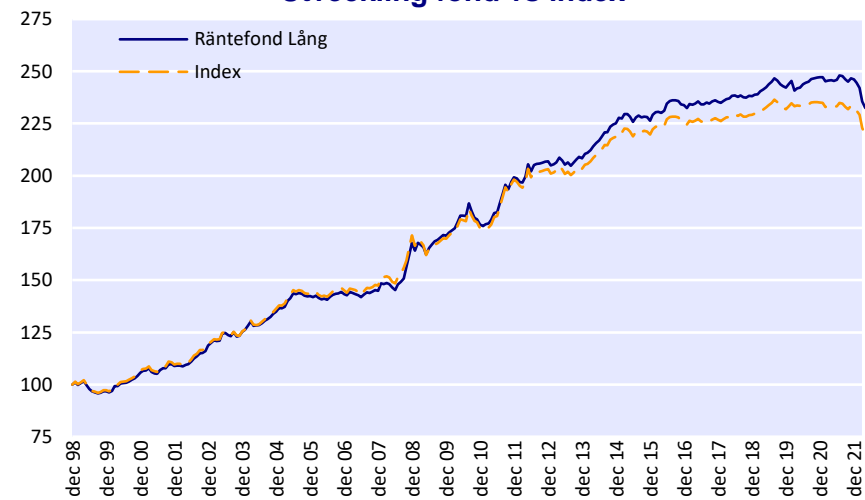
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



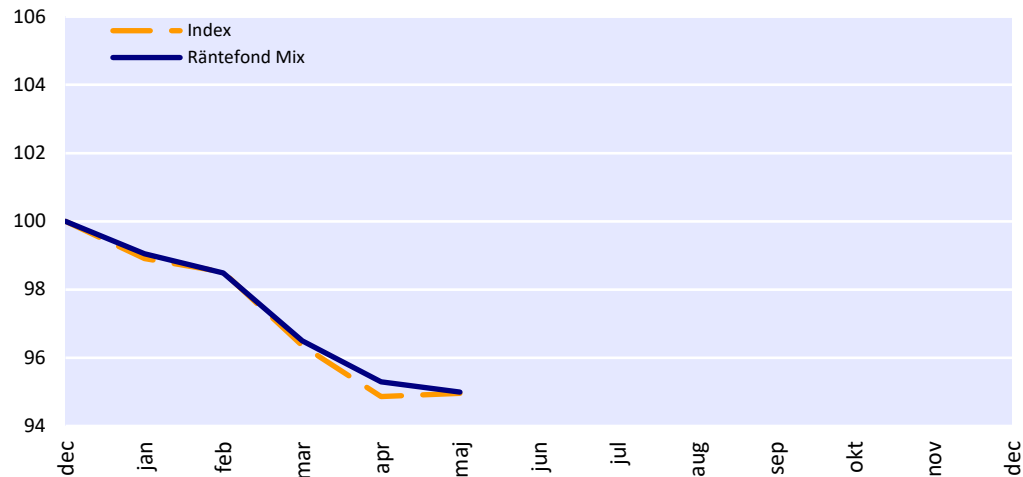
Utveckling fond vs index



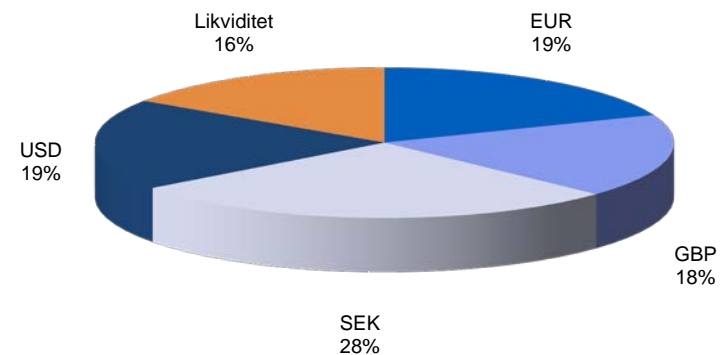
AMF RÄNTEFOND MIX

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
2021-12-31 - 2022-12-31



Placeringar i Räntefond Mix
Emittentfördelning, %



Räntefond Mix	
Totalt antal andelar	28 921 505
Total förmögenhet MSEK	3 265,6
Likviditet *	15,6%
Duration	3,62
Modifierad duration	3,56%
Modifierad duration krediter	1,86%
Yield	1,53%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	3,88
Avkastning från årets början	-5,01%
Avkastning Index	-5,04%
Nav-kurs	112,91

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Stat USA	18,7
Stat Storbritannien	17,6
Stat Tyskland	15,1
Stat Sverige	5,7
Stat Italien	3,9
	61,0

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 170531-220531 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 3 265,6

Avkastning - portfölj -3,6%

Avkastning - index -4,2%

Skillnad 0,6%

Riskindikator 2

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating ** -

Volatilitet - portfölj 2,0%

Volatilitet - index 2,2%

Aktiv risk 0,4%

Info. Kvot 0,31

Sharpekvot - portfölj -0,12

Jensens alfa 0,1%

Beta 0,93

Förklaringsgrad 96,8%

Konsistens 65,0%

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016
Marknadsvärde (MSEK)	3 265,6	3 400,0	3 375,6	1 790,2	1 285,9	990,9	905,7

Avkastning - portfölj -5,0%

Avkastning - index -5,0%

Skillnad 0,0%

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

Avkastning - portfölj -5,0%

Avkastning - index -5,0%

Skillnad -0,4%

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

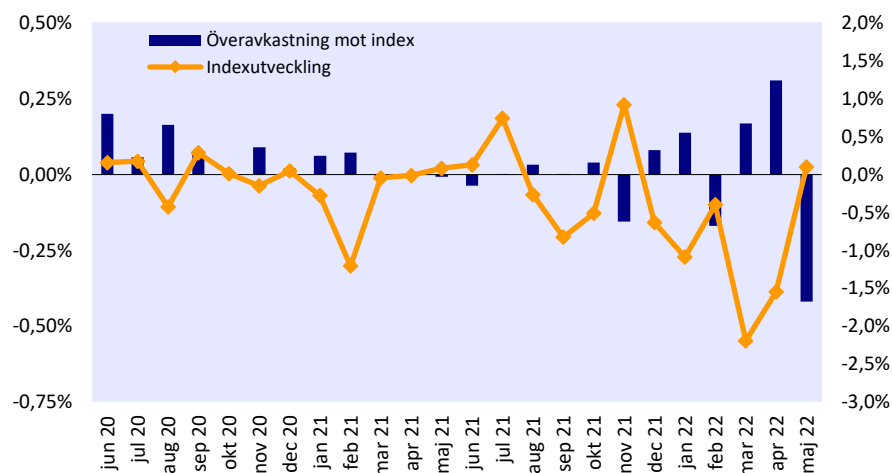
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

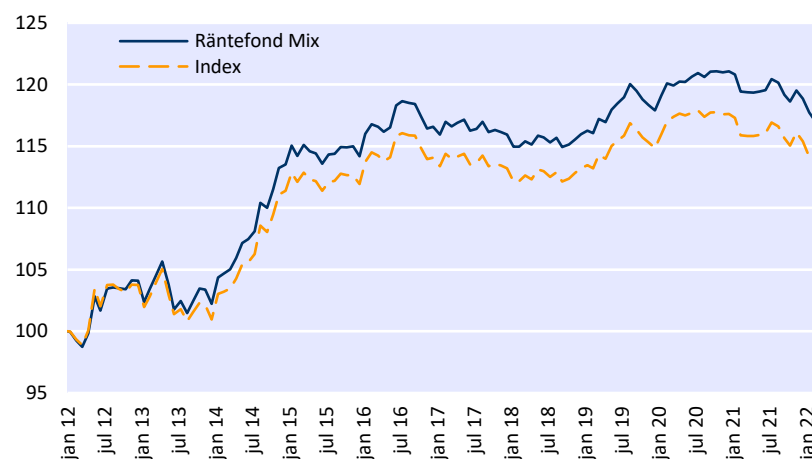
Överavkastning

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.