

AMF Fonder AB - Månadsrapport

per 2021-04-30

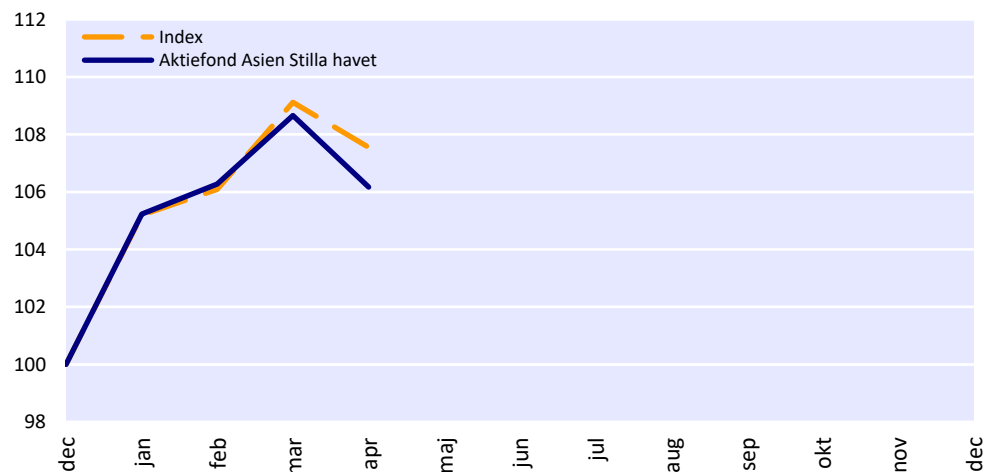


AMF Fonder AB, 113 88 Stockholm
Besöksadress: Klara Södra Kyrkogata 18
Telefon 08-696 31 00
www.amf.se
Org nr 556549-2922 Bolagets säte: Stockholm

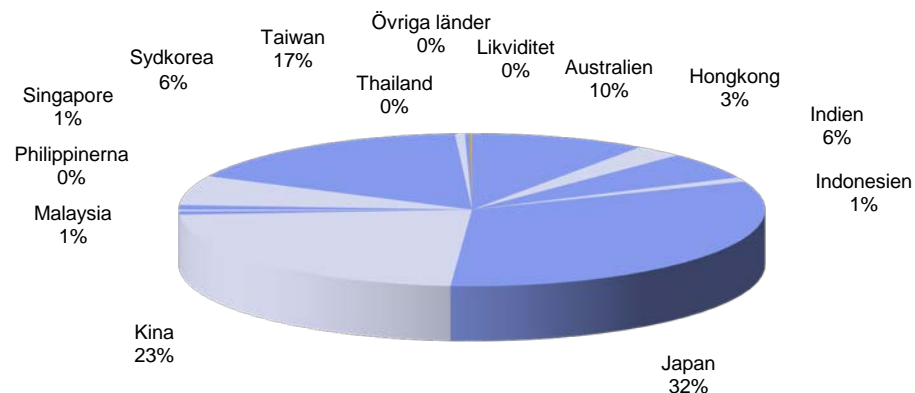
AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Asien och Stillahavsområdet.

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



Placeringar i Aktiefond Asien Stilla havet
Länderfördelning, %



Aktiefond Asien Stilla havet	
Totalt antal andelar	7 862 208
Total förmögenhet MSEK	2 251,5
Likviditet *	0,1%
Avkastning från årets början	6,17%
Avkastning Index	7,55%
Nav-kurs	286,37

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semiconductor Manufactu	9,4
Alibaba Group Holding, Kina	7,4
Tencent Holdings, Kina	7,0
Sony, Japan	3,9
Mediatek, Taiwan	2,8

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Hong Kong Exchange & Clearing, Hong Kong	2,6
Murata Manufacturing, Japan	2,5
Keyence, Japan	2,3
Sumitomo Mitau Financial, Japan	2,2
Meituan Dianping, Kina	2,1
	42,2

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

AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Perioden 160430-210430 (5 år)*

Marknadsvärde (MSEK) 2 251,5

Avkastning - portfölj 98,7%

Avkastning - index 91,1%

Skillnad 7,6%

Riskindikator 6

Hållbarhetsbetyg 5

Morningstar rating ** 5

Volatilitet - portfölj 12,0%

Volatilitet - index 12,0%

Aktiv risk 1,4%

Info. Kvot 0,65

Sharpekvot - portfölj 1,28

Jensens alfa 1,1%

Beta 0,99

Förklaringsgrad 98,7%

Konsistens 60,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	2 251,5	1 801,9	1 305,1	918,9	979,3	1 584,8	1 319,4

Avkastning - portfölj	6,4%	12,3%	28,3%	-5,6%	17,2%	11,1%	6,5%
-----------------------	------	-------	-------	-------	-------	-------	------

Avkastning - index	7,6%	6,4%	28,5%	-6,8%	17,6%	13,1%	8,1%
--------------------	------	------	-------	-------	-------	-------	------

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

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-2,0%	1,2%	12,2%	27,0%	35,5%	98,7%	9,5%
Avkastning - index	-1,4%	2,2%	12,3%	23,7%	28,6%	91,1%	9,9%
Skillnad	-0,6%	-1,1%	-0,1%	3,3%	7,0%	7,6%	-0,4%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

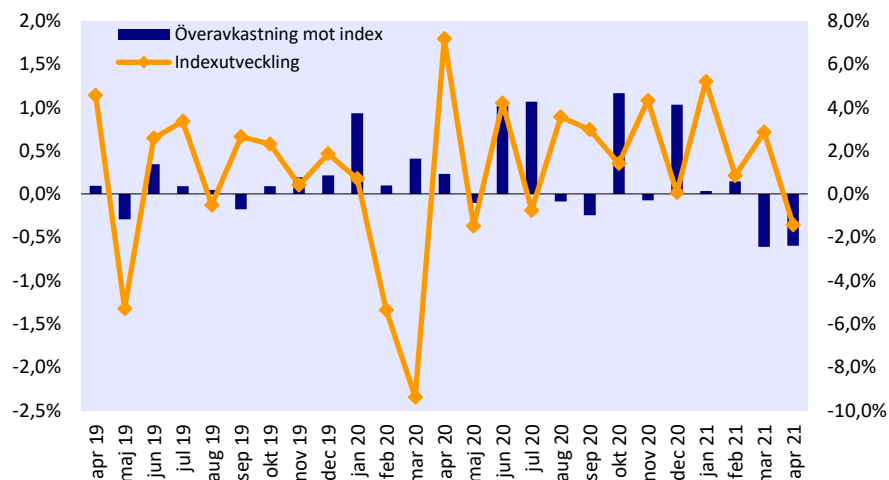
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

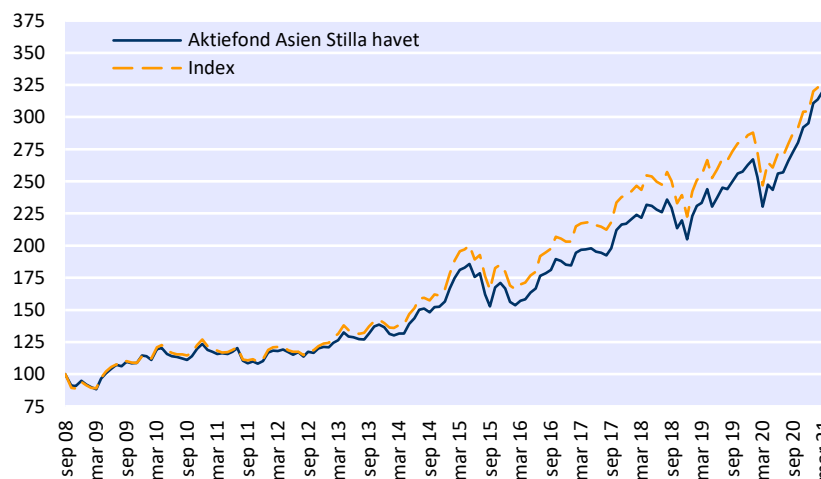
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



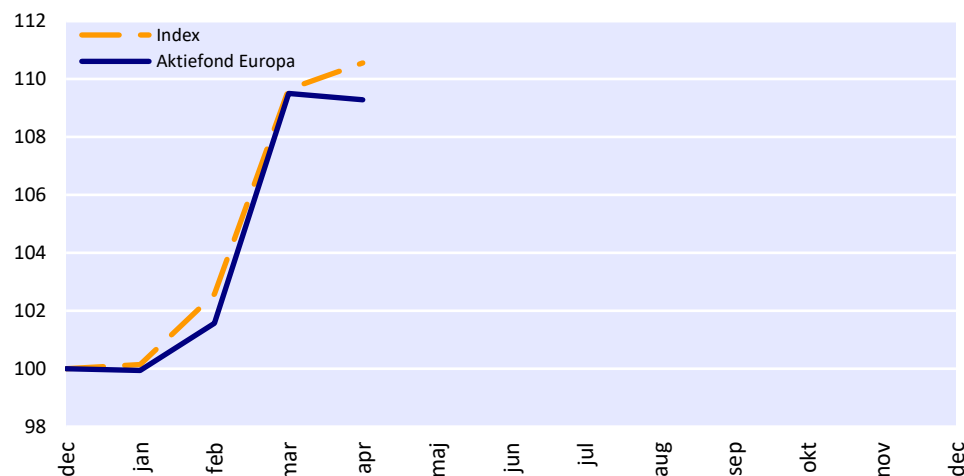
Utveckling fond vs index



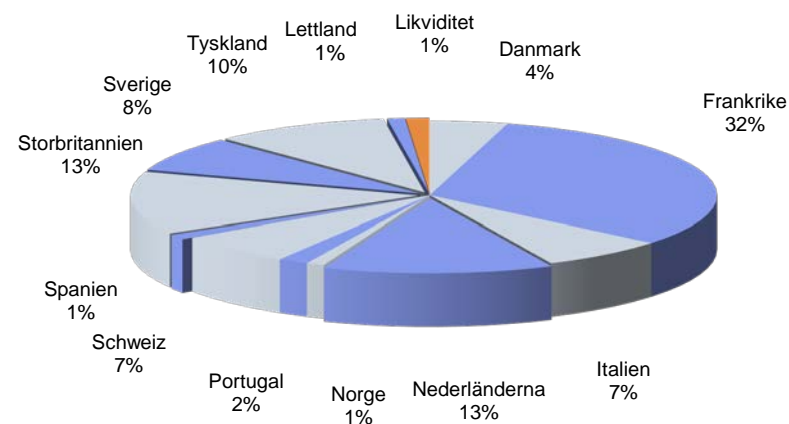
AMF AKTIEFOND EUROPA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Europa.

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



Placeringar i Aktiefond Europa
Länderfördelning, %



Aktiefond Europa	
Totalt antal andelar	24 155 649
Total förmögenhet MSEK	6 092,9
Likviditet *	1,3%
Avkastning från årets början	9,29%
Avkastning Index	10,56%
Nav-kurs	252,24

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Saint Gobain, Frankrike	4,6
Enel, Italien	4,0
Roche, Schweiz	4,0
Allianz, Tyskland	3,1
Vivendi, Frankrike	3,1

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
SAP, Tyskland	2,9
GlaxoSmithkline, Storbritannien	2,9
Total, Frankrike	2,9
Publicis, Frankrike	2,7
Unilever, Nederländerna	2,7
Totalt	33,0

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

AMF AKTIEFOND EUROPA

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	6 092,9
Avkastning - portfölj	63,9%
Avkastning - index	61,8%
Skillnad	2,0%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	14,6%
Volatilitet - index	14,0%
Aktiv risk	2,4%
Info. kvot	0,11
Sharpekvot - portfölj	0,75
Jensens alfa	0,0%
Beta	1,03
Förklaringsgrad	97,4%
Konsistens	60,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	6 092,9	5 480,6	5 611,9	4 362,4	5 558,7	4 162,5	4 157,7
Avkastning - portfölj	9,1%	1,1%	29,6%	-8,9%	12,1%	7,0%	6,4%
Avkastning - index	10,6%	-4,8%	32,5%	-6,2%	11,8%	5,6%	4,7%
Skillnad	-1,4%	5,9%	-2,8%	-2,7%	0,3%	1,4%	1,8%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	-0,4%	9,2%	24,3%	27,3%	22,2%	63,9%	6,2%
Avkastning - index	0,8%	10,4%	24,5%	22,5%	21,4%	61,8%	4,7%
Skillnad	-1,2%	-1,2%	-0,3%	4,8%	0,8%	2,0%	1,5%

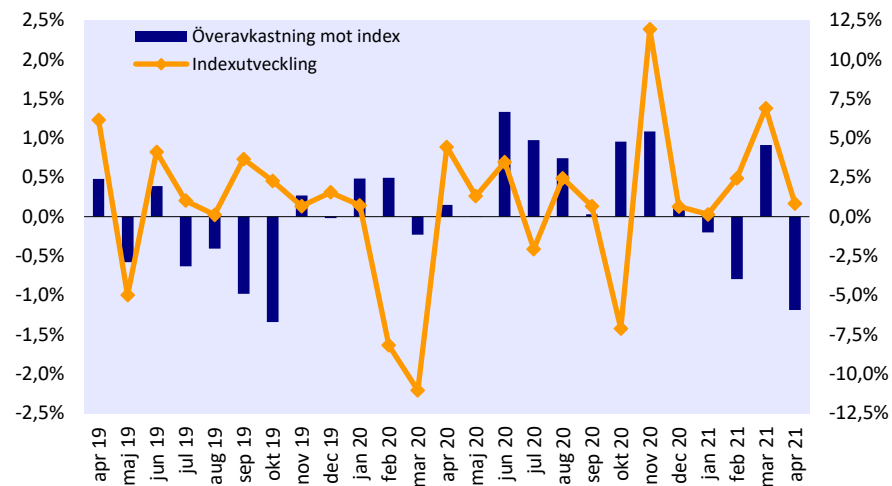
Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Europe NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

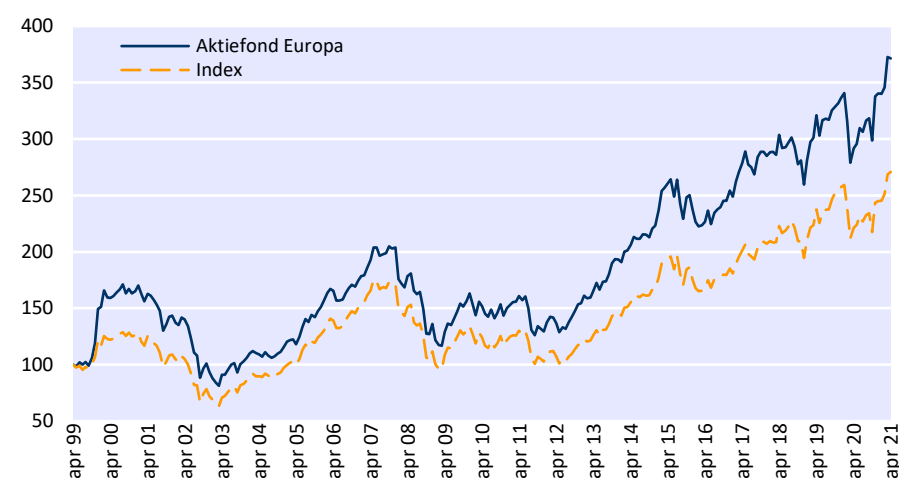
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



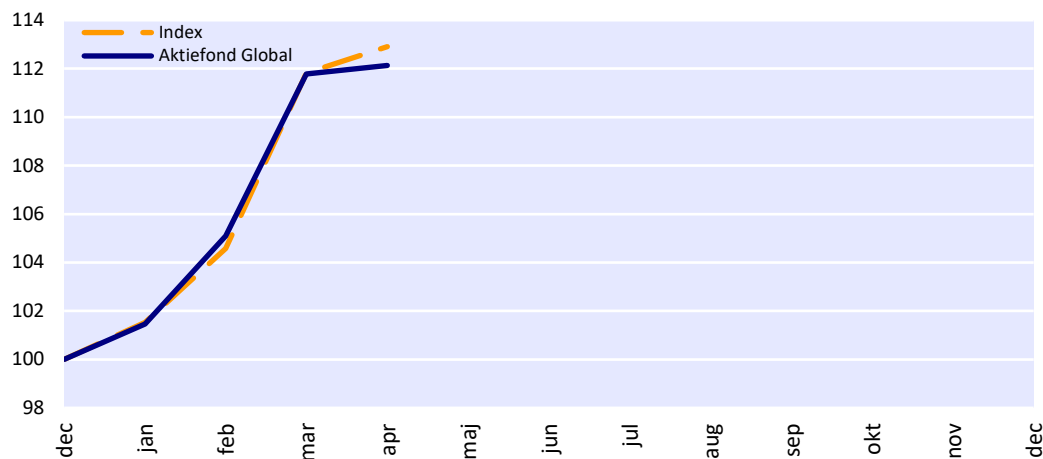
Utveckling fond vs index



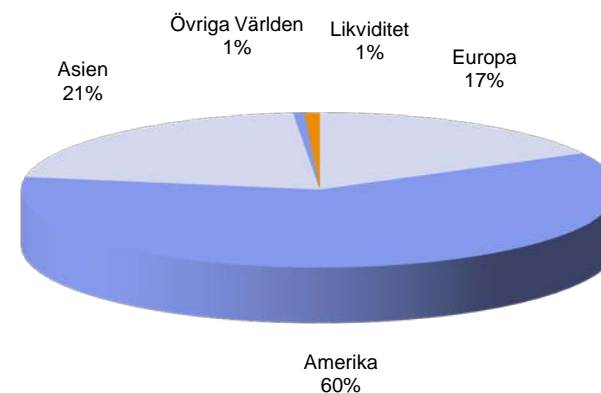
AMF AKTIEFOND GLOBAL

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

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



Placeringar i Aktiefond Global
Länderfördelning, %



Aktiefond Global	
Totalt antal andelar	91 813 939
Total förmögenhet MSEK	22 765,1
Likviditet *	0,8%
Avkastning från årets början	12,13%
Avkastning Index	12,91%
Nav-kurs	247,95

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft, USA	6,4
Alphabet, USA	5,6
Taiwan Semiconductor Manufactu	2,4
Alibaba Group Holding, Kina	2,0
Tesla, USA	1,7

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Procter & Gamble, USA	1,6
Visa, USA	1,5
Tencent Holdings, Kina	1,5
Nvidia, USA	1,5
Walt Disney, USA	1,4
	25,6

AMF AKTIEFOND GLOBAL

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	22 765,1
Avkastning - portfölj	106,6%
Avkastning - index	101,8%
Skillnad	4,8%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	12,5%
Volatilitet - index	13,3%
Aktiv risk	1,5%
Info. kvot	0,35
Sharpekvot - portfölj	1,29
Jensens alfa	1,5%
Beta	0,94
Förklaringsgrad	98,9%
Konsistens	48,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	22 765,1	19 221,8	17 424,4	3 657,2	3 522,8	3 188,1	2 507,6
Avkastning - portfölj	12,5%	5,2%	34,7%	-1,1%	10,1%	15,6%	6,7%
Avkastning - index	12,9%	1,8%	34,3%	-1,1%	10,9%	16,2%	5,6%
Skillnad	-0,5%	3,5%	0,4%	0,0%	-0,8%	-0,6%	1,1%

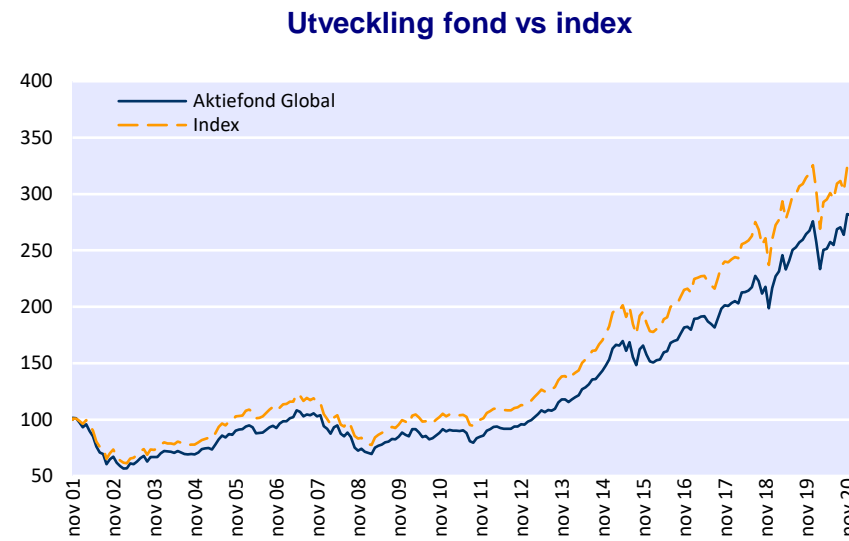
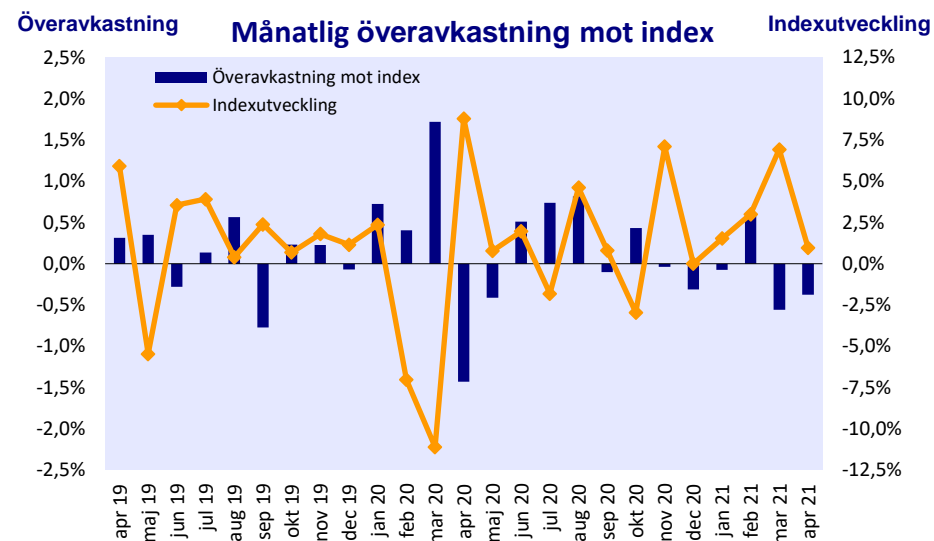
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,6%	10,8%	20,0%	26,3%	48,7%	106,6%	6,1%
Avkastning - index	1,0%	11,2%	20,9%	24,8%	43,1%	101,8%	6,9%
Skillnad	-0,4%	-0,4%	-0,9%	1,5%	5,6%	4,8%	-0,8%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

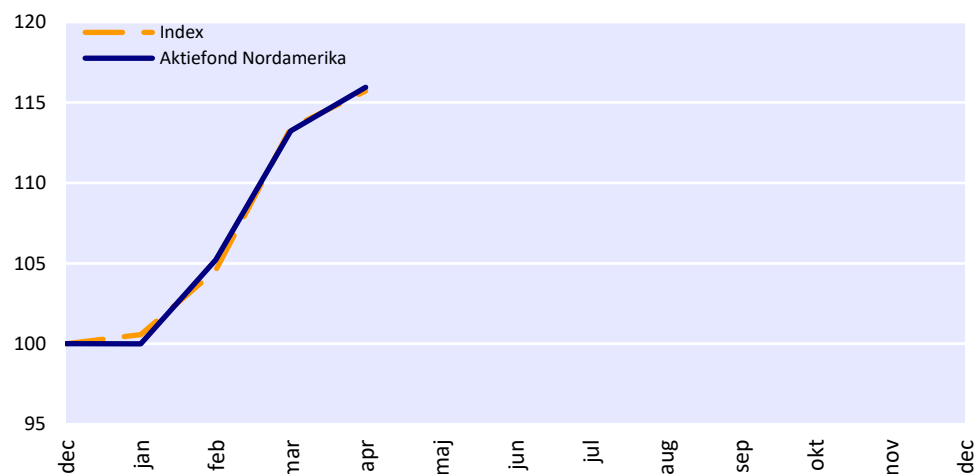
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



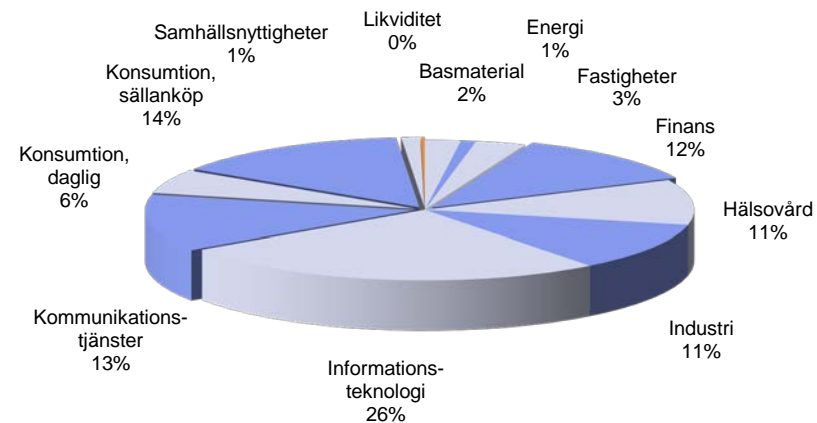
AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

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

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



Placeringar i Aktiefond Nordamerika
branschfördelning, %



Aktiefond Nordamerika	
Totalt antal andelar	8 854 746
Total förmögenhet MSEK	3 424,2
Likviditet *	0,2%
Avkastning från årets början	15,95%
Avkastning Index	15,72%
Nav-kurs	386,71

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft	10,0
Alphabet	9,3
Nvidia	3,0
Tesla	2,9
Visa	2,9

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Procter & Gamble	2,6
Walt Disney	2,4
Mastercard	2,2
Bristol-Myers Squibb	1,9
Nike	1,7
Totalt	38,8

AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

Perioden 160430-210430 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK)	3 424,2
Avkastning - portfölj	136,6%
Avkastning - index	129,4%
Skillnad	7,2%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	14,3%
Volatilitet - index	14,7%
Aktiv risk	1,5%
Info. Kvot	0,48
Sharpekvot - portfölj	1,36
Jensens alfa	1,3%
Beta	0,97
Förklaringsgrad	99,0%
Konsistens	51,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	3 424,2	2 761,4	2 826,5	1 808,6	1 528,3	1 751,1	1 267,5

Avkastning - portfölj	16,4%	6,2%	39,0%	5,3%	6,9%	18,7%	10,1%
Avkastning - index	15,7%	3,7%	38,2%	4,3%	8,0%	19,6%	8,1%
Skillnad	0,7%	2,5%	0,7%	1,0%	-1,1%	-0,9%	2,0%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	2,8%	16,4%	23,1%	28,9%	70,7%	136,6%	11,2%
Avkastning - index	2,0%	15,1%	22,8%	25,6%	62,1%	129,4%	12,0%
Skillnad	0,8%	1,4%	0,3%	3,3%	8,5%	7,2%	-0,8%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

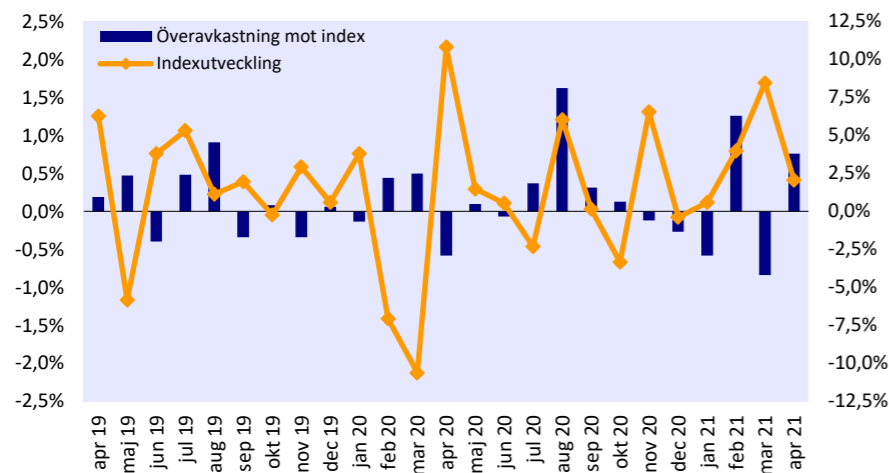
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

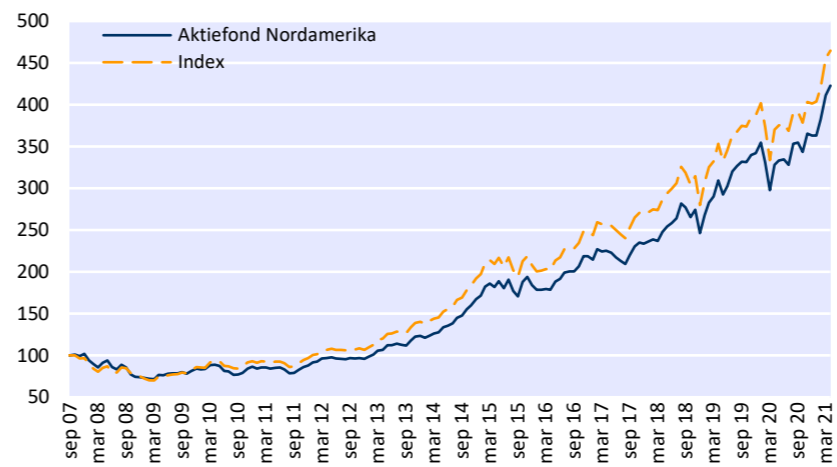
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



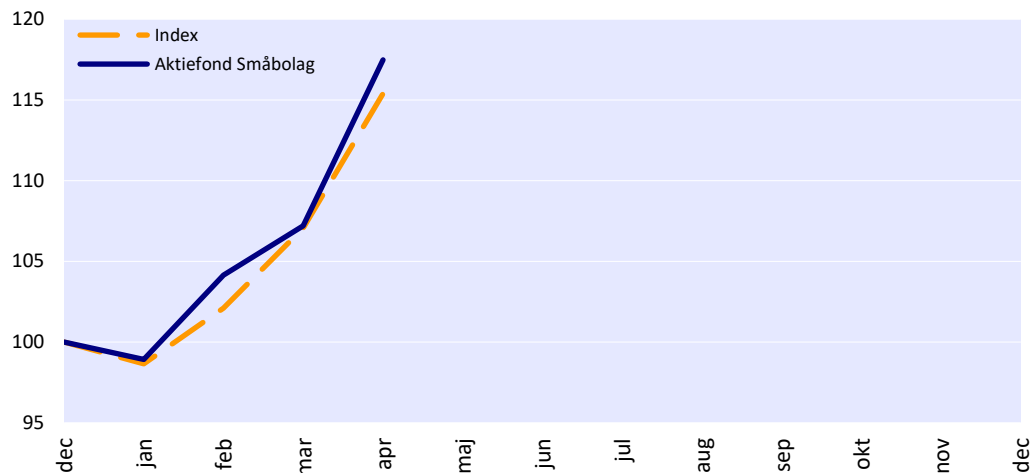
Utveckling fond vs index



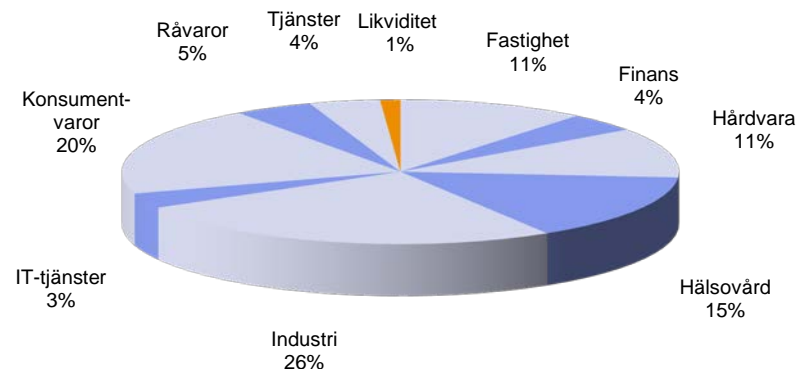
AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

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

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



Placeringar i Aktiefond Småbolag
Branschfördelning, %



Aktiefond Småbolag

Totalt antal andelar	14 774 094
Total förmögenhet MSEK	20 287,6
Likviditet *	1,2%
Avkastning från årets början	17,48%
Avkastning index	15,39%
Nav-kurs	1373,19

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

Största aktieinnehav

Portföljandel, %

Sinch	4,3
Avanza	3,1
Medicover	2,7
Trelleborg	2,6
SwedenCare	2,6

Största aktieinnehav

Portföljandel, %

Nibe	2,6
AddLife	2,5
Indutrade	2,5
Getinge	2,5
Bure	2,5
Totalt	27,8

AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	20 287,6
Avkastning - portfölj	192,1%
Avkastning - index	150,6%
Skillnad	41,5%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	17,2%
Volatilitet - index	17,5%
Aktiv risk	3,9%
Info. kvot	0,96
Sharpekvot - portfölj	1,43
Jensens alfa	4,3%
Beta	0,97
Förklaringsgrad	94,9%
Konsistens	60,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	20 287,6	16 069,7	9 803,5	6 723,3	7 358,6	6 492,9	5 666,5
Avkastning - portfölj	17,5%	41,5%	42,2%	-2,6%	9,6%	13,0%	34,2%
Avkastning - index	15,4%	23,0%	43,2%	-0,2%	8,8%	12,2%	30,1%
Skillnad	2,1%	18,5%	-1,0%	-2,4%	0,8%	0,9%	4,2%

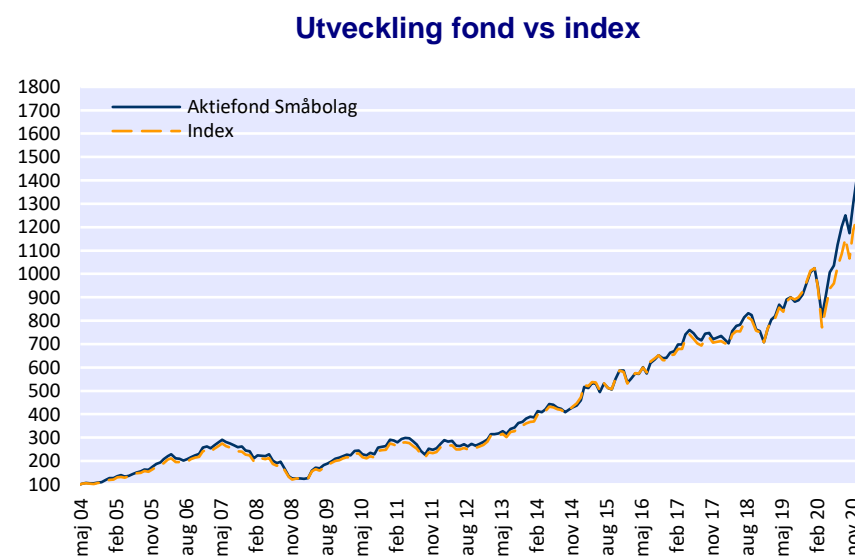
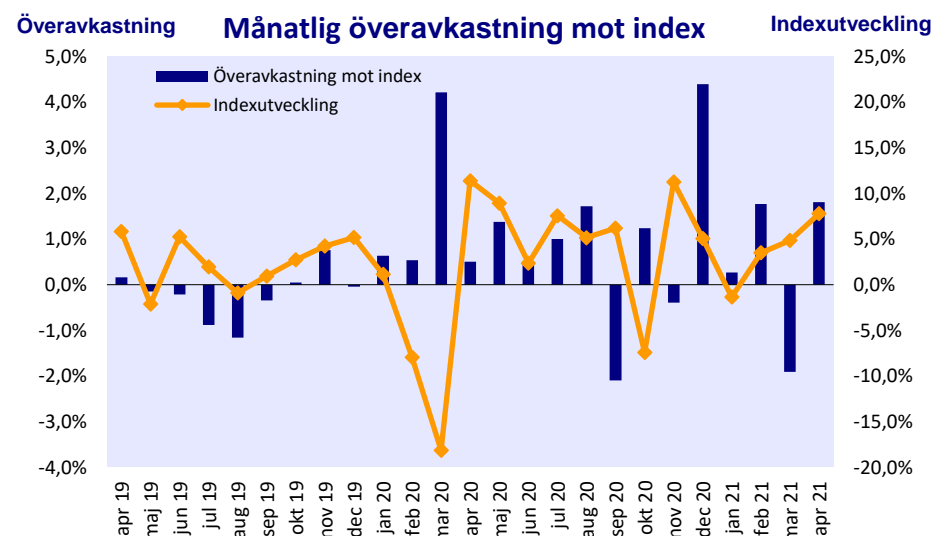
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	9,6%	18,8%	42,6%	83,2%	121,5%	192,1%	18,1%
Avkastning - index	7,8%	17,0%	34,9%	67,2%	94,0%	150,6%	17,0%
Skillnad	1,8%	1,8%	7,7%	16,0%	27,6%	41,5%	1,0%

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

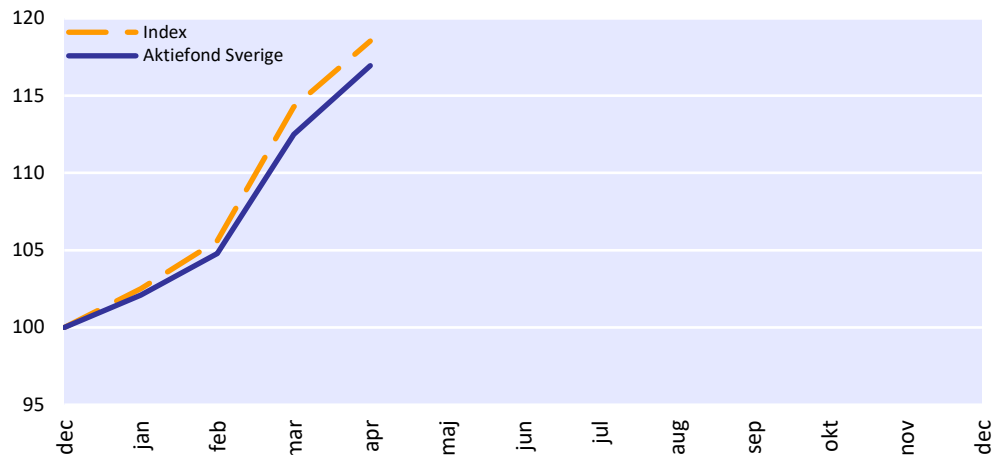
***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



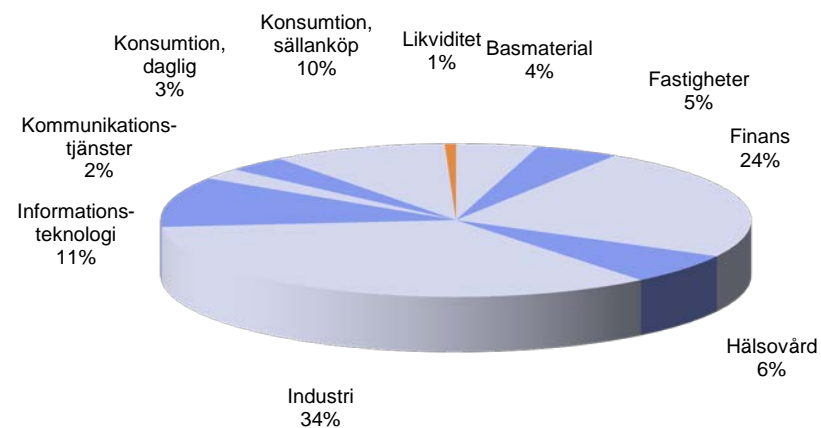
AMF AKTIEFOND SVERIGE

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

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



Placeringar i Aktiefond Sverige
Branschfördelning, %



Aktiefond Sverige	
Totalt antal andelar	49 894 711
Total förmögenhet MSEK	42 871,4
Likviditet *	0,6%
Avkastning från årets början	16,94%
Avkastning Index	18,54%
Nav-kurs	859,24

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	9,8
Atlas Copco	6,2
SEB	5,0
Volvo	4,3
Hexagon	3,9

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Ericsson	3,8
Kinnevik	3,5
Essity	3,3
Epiroc	3,2
Latour	3,1
Totalt	46,0

Referensindex: SIXPRX

AMF AKTIEFOND SVERIGE

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	42 871,4

Avkastning - portfölj	90,4%
Avkastning - index	116,4%
Skillnad	-26,0%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	3
Volatilitet - portfölj	15,1%
Volatilitet - index	15,0%
Aktiv risk	1,7%
Info. kvot	-1,71
Sharpekvot - portfölj	0,95
Jensens alfa	-2,9%
Beta	1,00
Förklaringsgrad	98,7%
Konsistens	31,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	42 871,4	37 056,3	33 846,3	25 371,6	27 691,6	27 500,3	26 529,6

Avkastning - portfölj	16,9%	11,7%	25,7%	-4,9%	7,9%	8,6%	8,6%
Avkastning - index	18,5%	14,8%	35,0%	-4,6%	10,0%	9,2%	6,3%
Skillnad	-1,6%	-3,1%	-9,3%	-0,2%	-2,2%	-0,5%	2,4%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	4,0%	14,6%	32,2%	49,6%	50,1%	90,4%	12,2%
Avkastning - index	3,7%	15,6%	33,7%	53,3%	67,8%	116,4%	10,6%
Skillnad	0,2%	-1,1%	-1,5%	-3,6%	-17,7%	-26,0%	1,6%

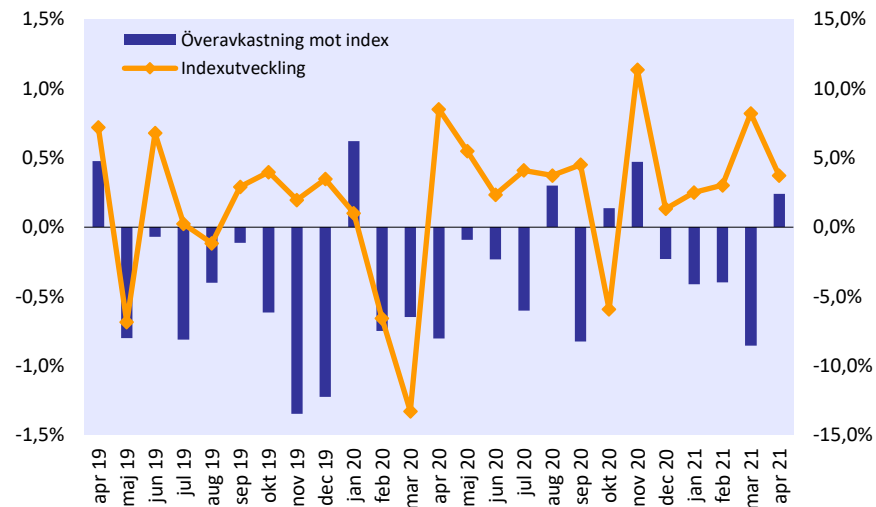
Referensindex: SIXPRX

* Alla värden beräknas inkl avgifter

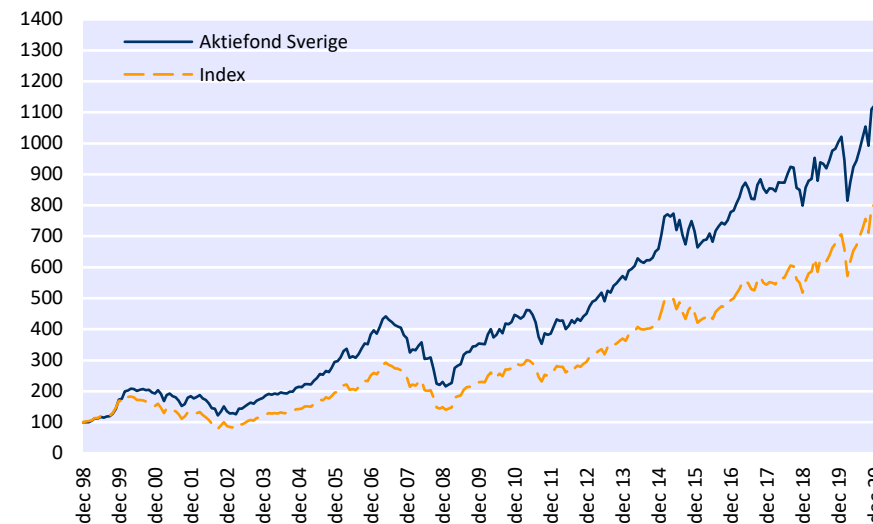
** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



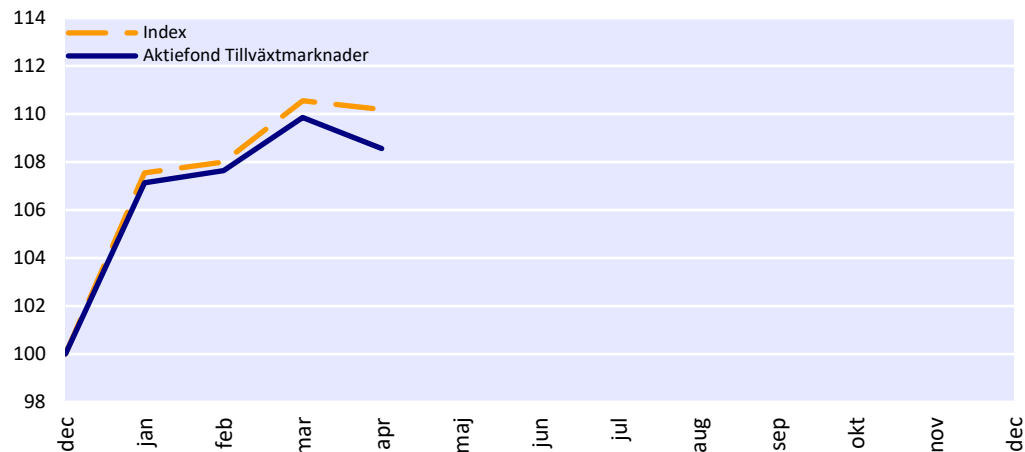
Utveckling fond vs index



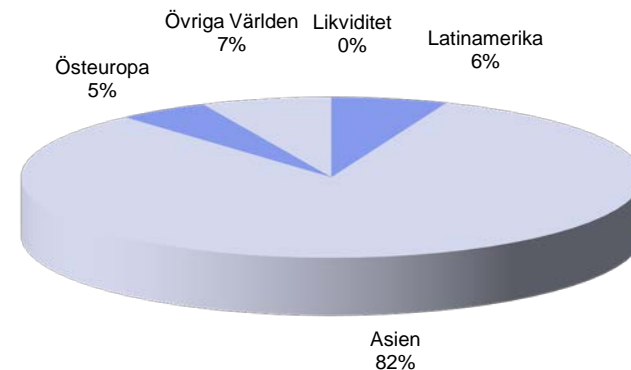
AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

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

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



**Placeringar i Aktiefond
Tillväxtmarknader
Regionfördelning, %**



Aktiefond Tillväxtmarknader	
Totalt antal andelar	18 188 784
Total förmögenhet MSEK	2 228,4
Likviditet *	0,0%
Avkastning från årets början	8,57%
Avkastning Index	10,20%
Nav-kurs	122,52

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Tencent Holdings, Kina	9,6
Taiwan Semiconductor Manufac	9,6
Alibaba Group Holding, Kina	9,5
Mediatek, Taiwan	3,1
Meituan Dianping, Kina	2,9

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Naspers, Sydafrika	2,5
Reliance Industries, Indien	2,5
LG Chem, Sydkorea	1,8
Chailease Holding, Taiwan	1,8
Infosys, Indien	1,7
	45,0

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

AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

Perioden 191211-210331 ^{1),2)}	
Marknadsvärde (MSEK)	2 228,4
Avkastning - portfölj	22,5%
Avkastning - index	21,3%
<i>Skillnad</i>	1,2%

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

	2021	2020	2019
Marknadsvärde (MSEK)	2 228,4	1 653,4	322,2
Avkastning - portfölj	8,8%	7,9%	4,4%
Avkastning - index	10,2%	5,4%	4,5%
<i>Skillnad</i>	-1,4%	2,5%	-0,1%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	Start ⁴⁾
Avkastning - portfölj	-1,0%	1,6%	14,7%	33,0%	15,9%
Avkastning - index	-0,3%	2,5%	12,8%	30,9%	15,1%
<i>Skillnad</i>	-0,6%	-0,9%	1,9%	2,1%	0,9%

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

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

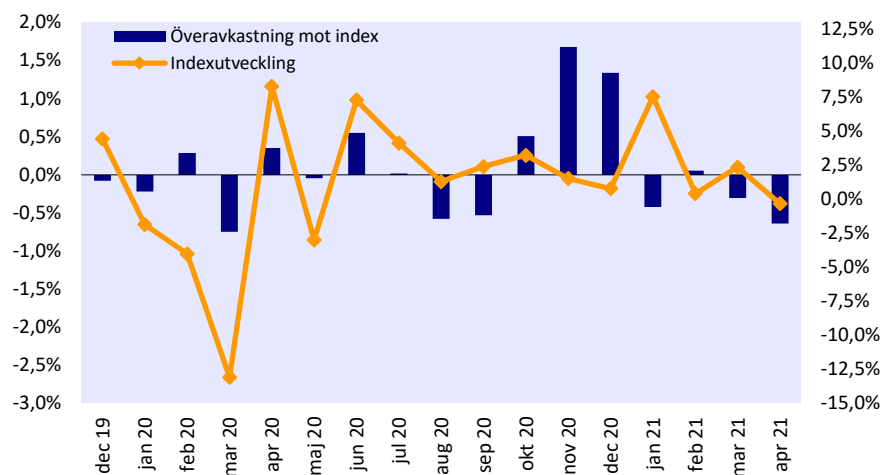
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

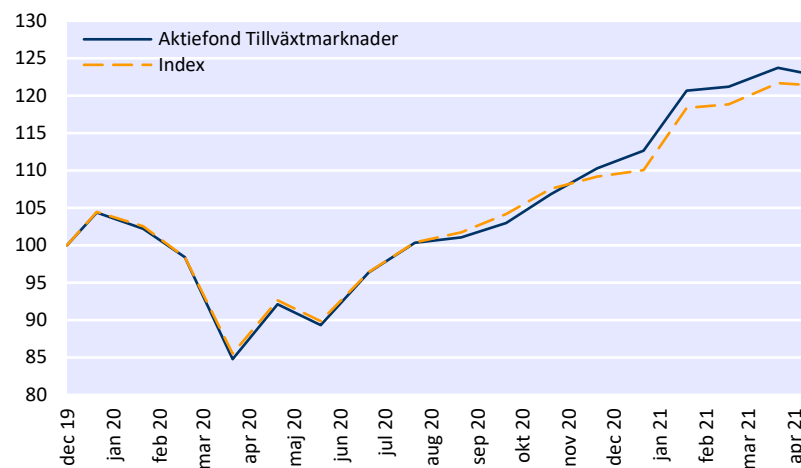
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



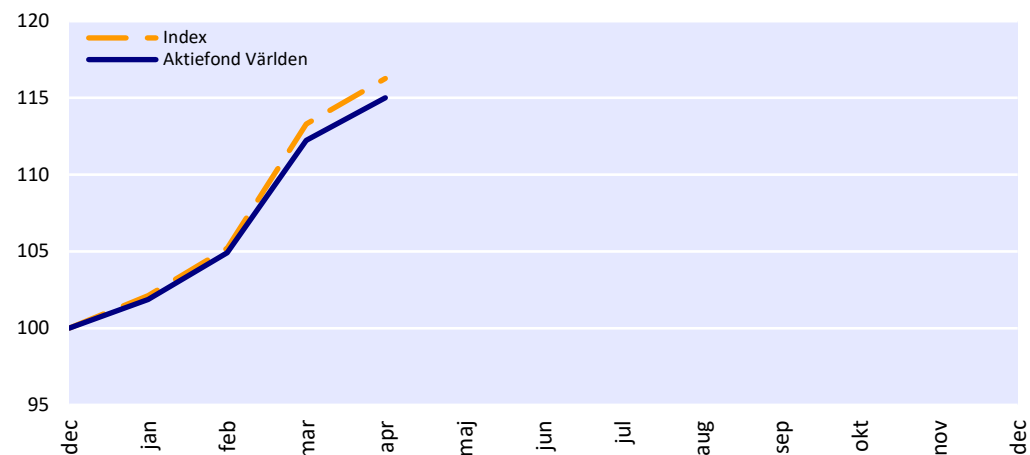
Utveckling fond vs index



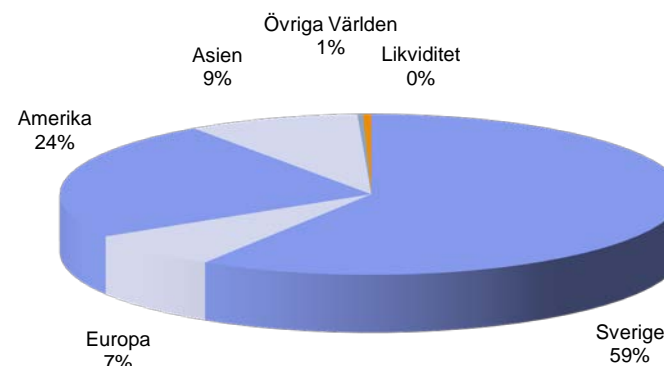
AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

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

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



Placeringar i Aktiefond Världen
Regionfördelning, %



Aktiefond Världen	
Totalt antal andelar	83 723 816
Total förmögenhet MSEK	46 634,8
Likviditet *	0,4%
Avkastning från årets början	15,01%
Avkastning Index	16,26%
Nav-kurs	557,01

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Alphabet, USA	2,2
Hexagon	2,2
Ericsson	2,1
Kinnevik	2,1
Essity	1,9
Totalt	27,6

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

AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	46 634,8
Avkastning - portfölj	92,9%
Avkastning - index	111,3%
Skillnad	-18,4%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	3
Volatilitet - portfölj	13,7%
Volatilitet - index	13,8%
Aktiv risk	1,4%
Info. kvot	-1,48
Sharpekvot - portfölj	1,07
Jensens alfa	-1,9%
Beta	0,99
Förklaringsgrad	98,9%
Konsistens	35,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	46 634,8	41 075,8	39 160,8	31 486,5	33 731,8	32 024,0	29 410,8
Avkastning - portfölj	15,1%	8,0%	28,3%	-3,7%	8,1%	11,6%	8,7%
Avkastning - index	16,3%	9,6%	34,8%	-3,2%	10,5%	12,0%	6,0%
Skillnad	-1,1%	-1,5%	-6,5%	-0,5%	-2,4%	-0,4%	2,7%

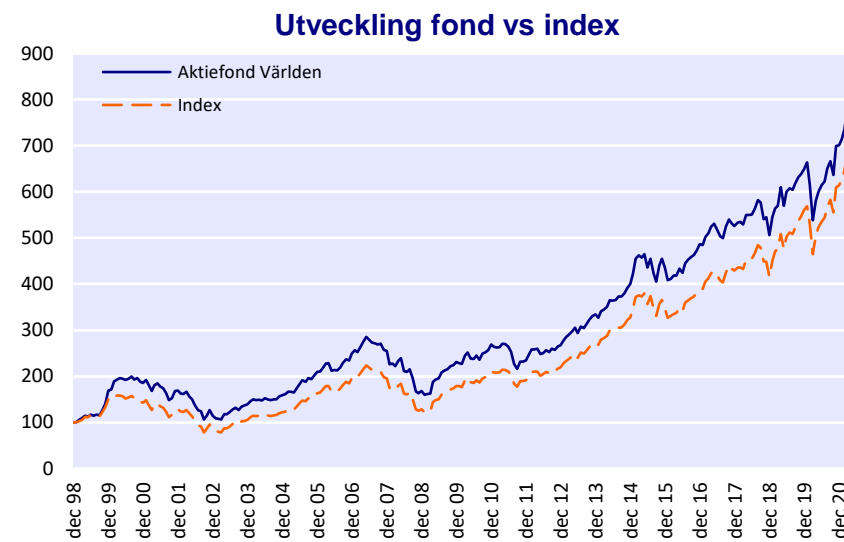
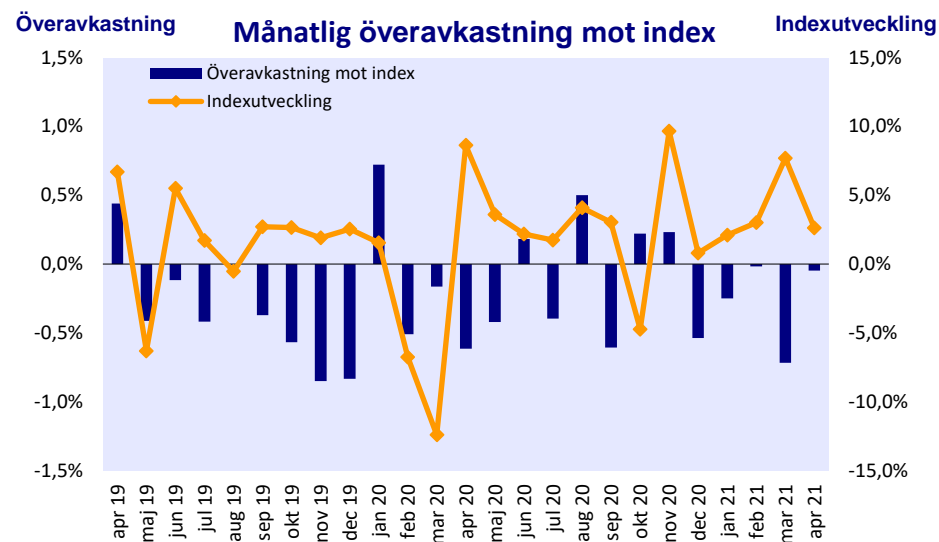
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	2,6%	13,0%	26,8%	38,9%	46,8%	92,9%	9,8%
Avkastning - index	2,6%	13,9%	28,5%	41,4%	57,9%	111,3%	9,2%
Skillnad	0,0%	-0,8%	-1,7%	-2,5%	-11,1%	-18,4%	0,6%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

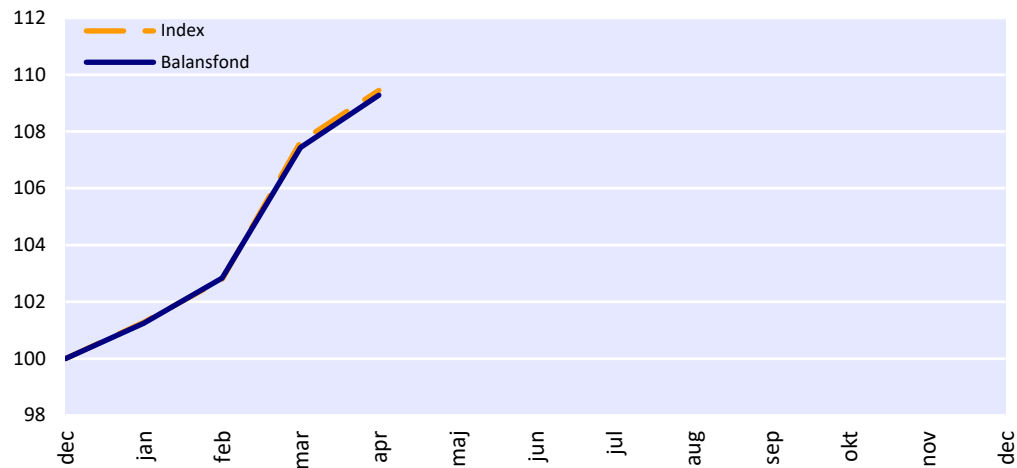
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



AMF BALANSFOND

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

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



Placeringar i Balansfond
fördelning aktier/räntebärande, %



Balansfond	
Totalt antal andelar	72 472 405
Total förmögenhet MSEK	25 976,7
Likviditet *	0,0%
Modifierad duration	3,61%
Avkastning från årets början	9,28%
Avkastning Index	9,45%
Nav-kurs	358,44

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	4,3
Atlas Copco	2,6
SEB	2,1
Volvo	1,9
Hexagon	1,7
Totalt	12,5

Största ränteb. Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	6,4
SEB Bolån	4,0
SBAB	3,4
Volkswagen Finans	2,7
Swedbank Hypotek	2,1
Totalt	18,6

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

AMF BALANSFOND

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	25 976,7

Avkastning - portfölj	53,8%
Avkastning - index	61,9%
<i>Skillnad</i>	-8,1%

Riskindikator	4
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	8,7%
Volatilitet - index	8,4%
Aktiv risk	1,0%
Info. kvot	-1,12
Sharpekvot - portfölj	1,10
Jensens alfa	-1,5%
Beta	1,03
Förklaringsgrad	98,7%
Konsistens	35,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	25 976,7	23 820,1	23 265,8	20 513,5	21 734,7	21 288,0	20 303,8

Avkastning - portfölj	9,4%	6,0%	16,9%	-1,9%	5,2%	8,3%	5,6%
Avkastning - index	9,4%	7,3%	20,5%	-1,5%	6,4%	8,1%	4,1%
<i>Skillnad</i>	-0,1%	-1,3%	-3,7%	-0,5%	-1,2%	0,1%	1,4%

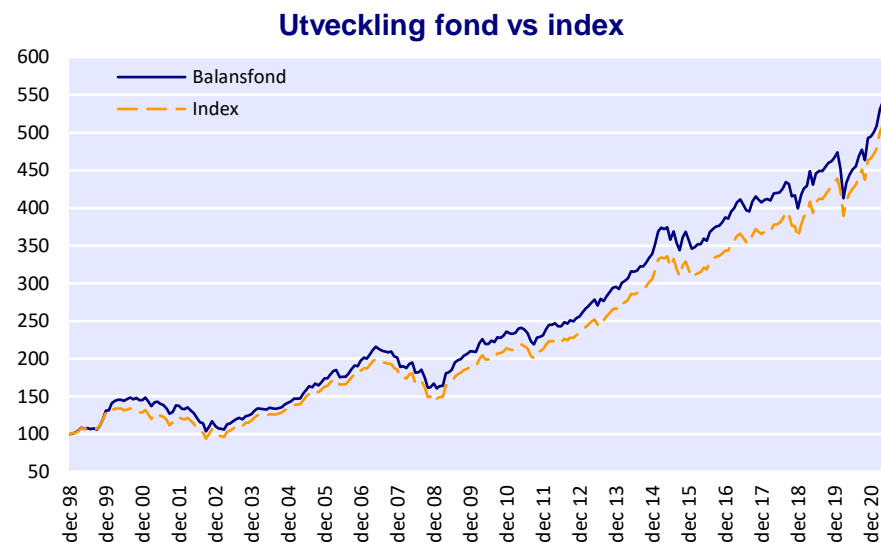
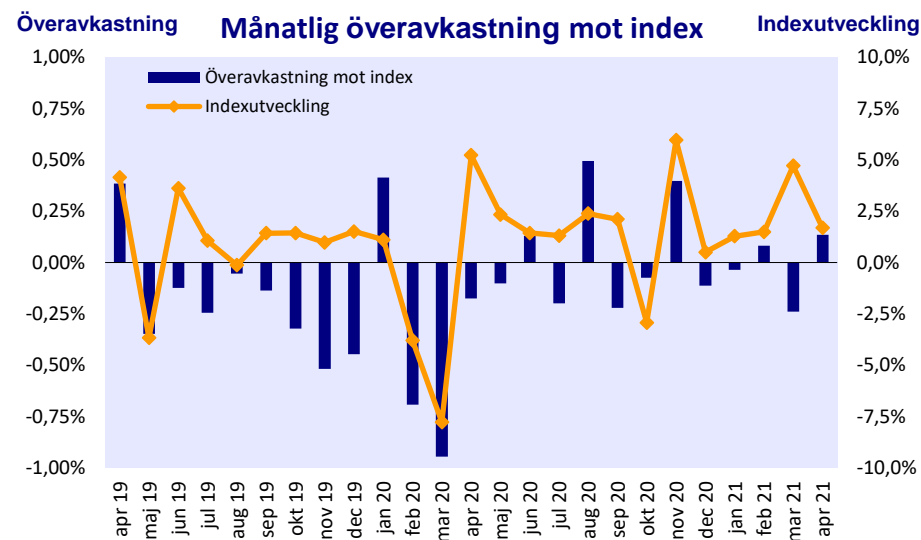
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	1,8%	8,0%	16,8%	24,7%	29,0%	53,8%	7,9%
Avkastning - index	1,7%	8,1%	16,6%	24,4%	35,0%	61,9%	7,6%
<i>Skillnad</i>	0,1%	0,0%	0,2%	0,3%	-6,0%	-8,1%	0,3%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

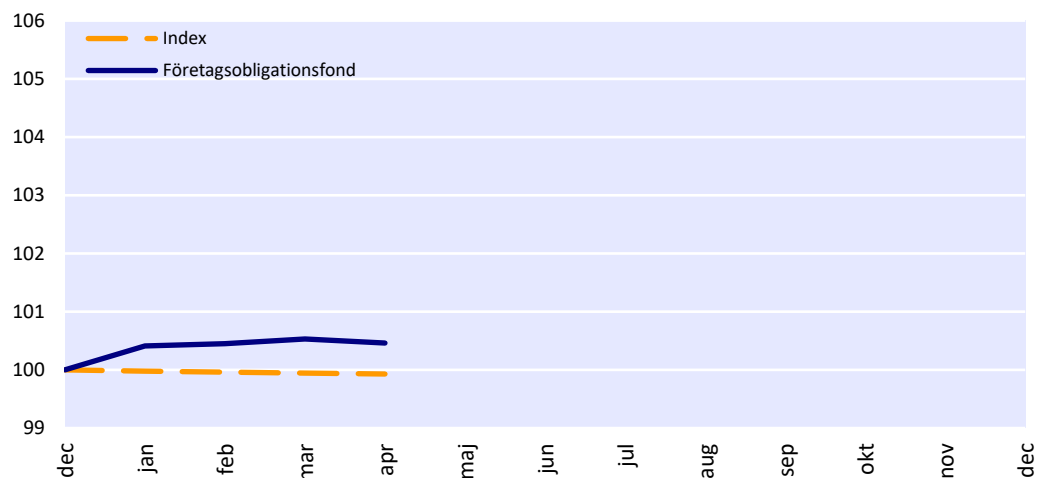
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



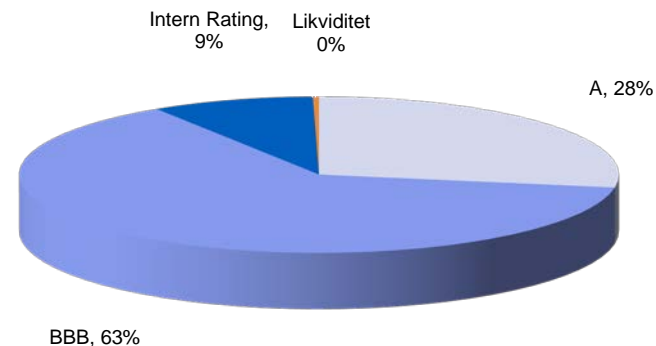
AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

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

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



Placeringar i Företagsobligationsfond
Rating, %



Företagsobligationsfond	
Totalt antal andelar	7 627 575
Total förmögenhet MSEK	780,7
Likviditet *	-0,3%
Duration	0,83
Modifierad duration	0,83%
Modifierad duration krediter	0,83%
Yield	0,66%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	3,15
Avkastning från årets början	0,46%
Avkastning index	-0,07%
Nav-kurs	102,36

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Castellum	7,2
SBAB Bank	6,9
Santander Consumer Bank	5,2
LF Bank	4,6
Bonnier Fastigheter	4,6
	28,5

AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

Perioden 180829-210430 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK) 780,7

Avkastning - portfölj 2,36%

Avkastning - index -1,07%

Skillnad 3,43%

Riskindikator ³⁾ 1

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating -

Volatilitet - portfölj ³⁾ 1,7%

Volatilitet - index ³⁾ 0,1%

Aktiv risk ²⁾ 2,4%

Info. Kvot ²⁾ 0,54

Sharpekvot - portfölj ²⁾ 0,84

Jensens alfa ²⁾ 0,7%

Beta ²⁾ 4,41

Förklaringsgrad ²⁾ 2,2%

Konsistens ²⁾ 75,8%

	2021	2020	2019	2018
Marknadsvärde (MSEK)	780,7	700,1	641,8	536,5

Avkastning - portfölj 0,62% 0,99% 1,60% -0,86%

Avkastning - index -0,07% -0,17% -0,53% -0,30%

Skillnad 0,69% 1,17% 2,13% -0,56%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	Start ⁴⁾
Avkastning - portfölj	0,09%	0,21%	1,45%	4,10%	0,88%
Avkastning - index	-0,02%	-0,05%	-0,09%	-0,15%	-0,40%
<i>Skillnad</i>	0,10%	0,25%	1,53%	4,25%	1,28%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

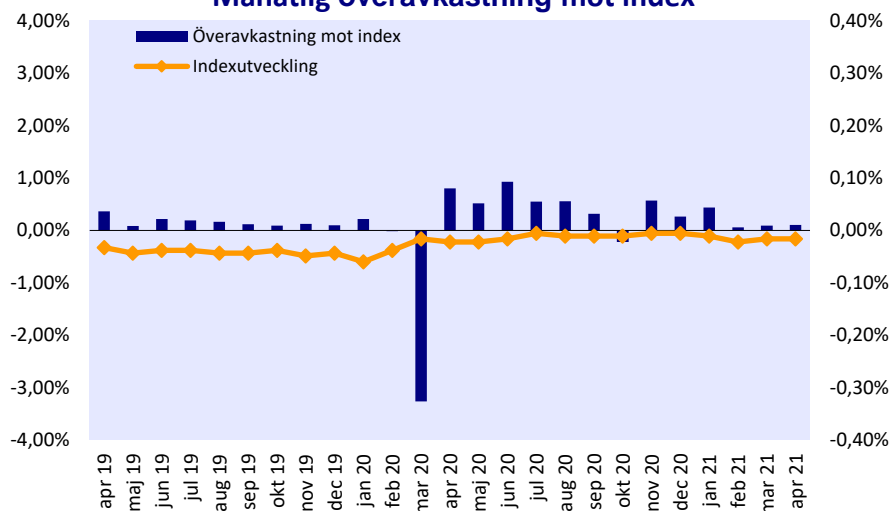
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

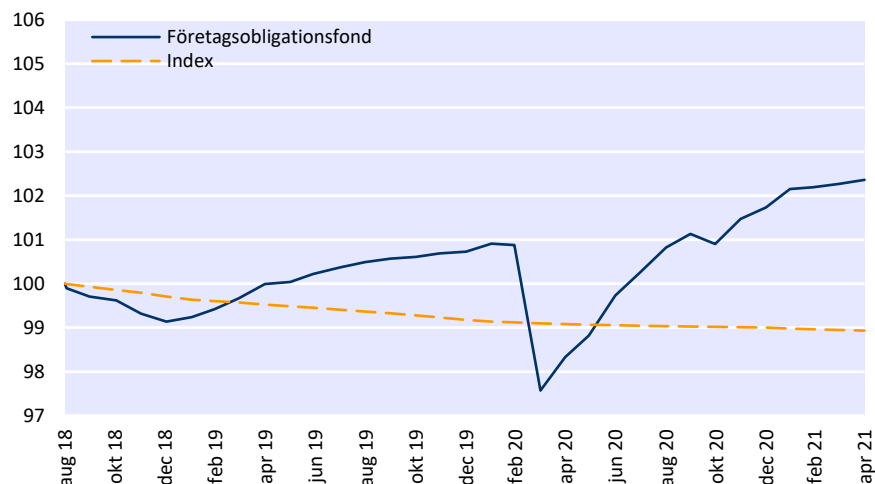
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



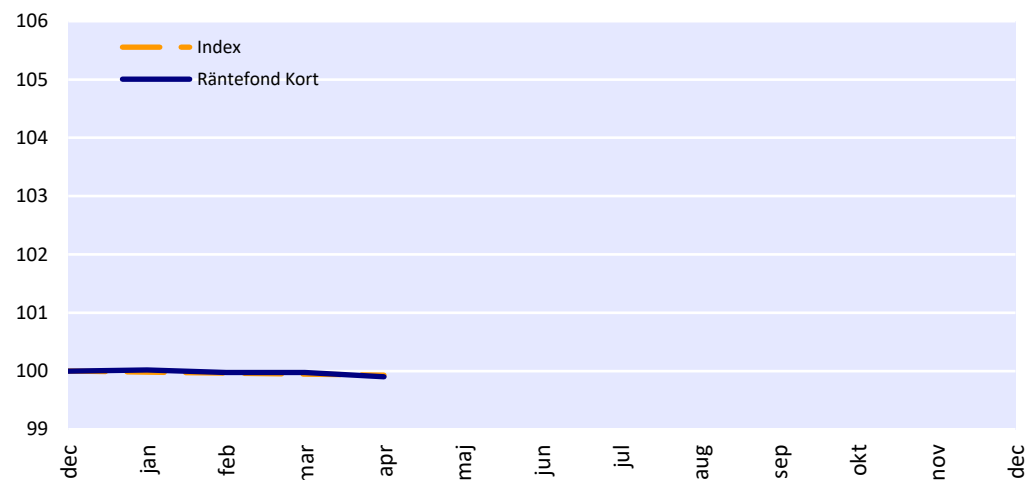
Utveckling fond vs index



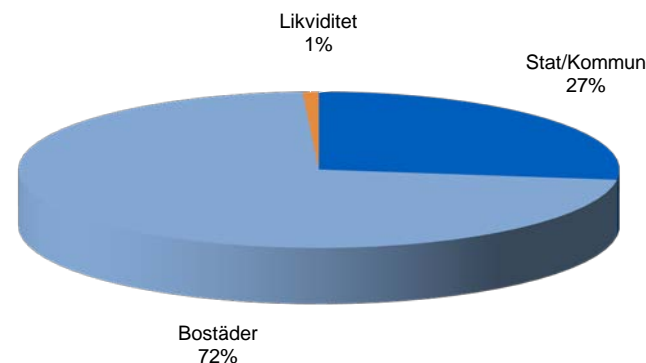
AMF RÄNTEFOND KORT

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

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



Placeringar i Räntefond Kort
Emittentfördelning, %



Räntefond Kort

Totalt antal andelar	46 404 027
Total förmögenhet MSEK	5 176,6
Likviditet *	0,9%
Duration	0,61
Modifierad duration	0,61%
Modifierad duration krediter	0,61%
Yield	0,00%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	2,33
Avkastning från årets början	-0,10%
Avkastning index	-0,07%
Nav-kurs	111,55

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Kommuninvest	19,6
Skandiabanken	17,3
Nykredit	17,2
Landshypotek	11,2
African Development Bank	7,5
Totalt	72,8

AMF RÄNTEFOND KORT

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	5 176,6

Avkastning - portfölj	-0,82%
Avkastning - index	-2,81%
<i>Skillnad</i>	1,99%

Riskindikator	1
Hållbarhetsbetyg	-
Morningstar rating **	-
Volatilitet - portfölj	0,2%
Volatilitet - index	0,1%
Aktiv risk	0,2%
Info. kvot	2,48
Sharpekvot - portfölj	2,27
Jensens alfa	0,4%
Beta	0,93
Förklaringsgrad	16,9%
Konsistens	91,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	5 176,6	5 582,1	4 443,6	5 252,2	4 834,0	5 384,6	6 380,6

Avkastning - portfölj	0,01%	0,27%	-0,30%	-0,46%	-0,34%	0,07%	-0,37%
Avkastning - index	-0,07%	-0,17%	-0,53%	-0,81%	-0,77%	-0,66%	-0,27%
<i>Skillnad</i>	0,08%	0,44%	0,23%	0,34%	0,43%	0,73%	-0,10%

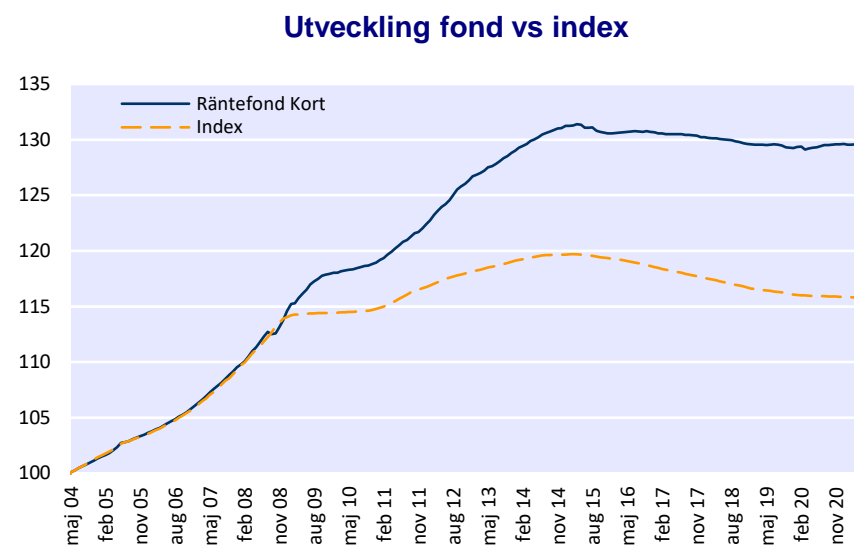
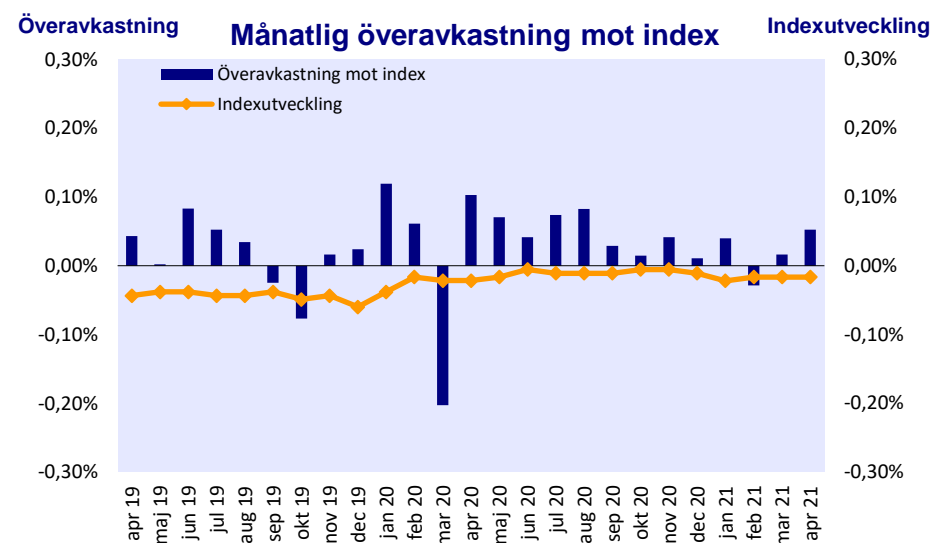
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,04%	-0,01%	0,04%	0,30%	-0,41%	-0,82%	1,54%
Avkastning - index	-0,02%	-0,05%	-0,09%	-0,15%	-1,33%	-2,81%	0,87%
<i>Skillnad</i>	0,05%	0,04%	0,13%	0,44%	0,92%	1,99%	0,67%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

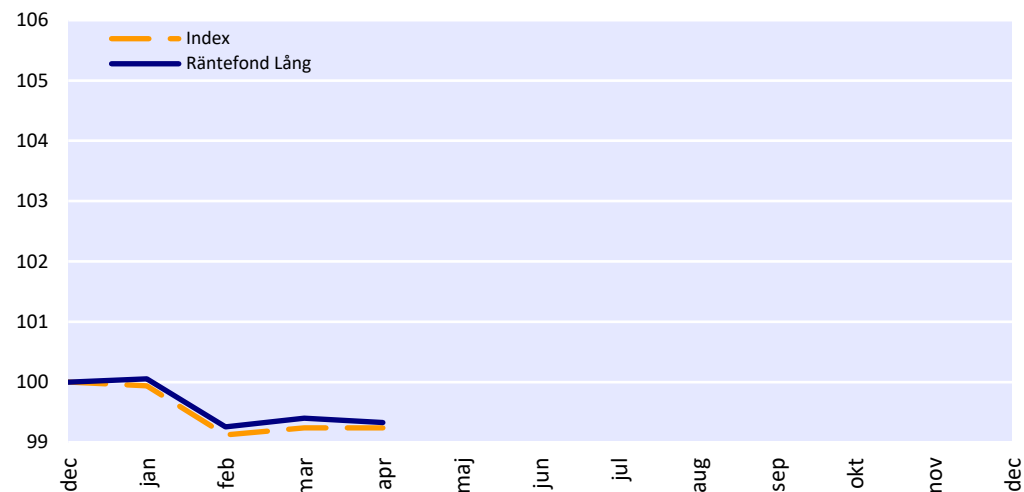
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



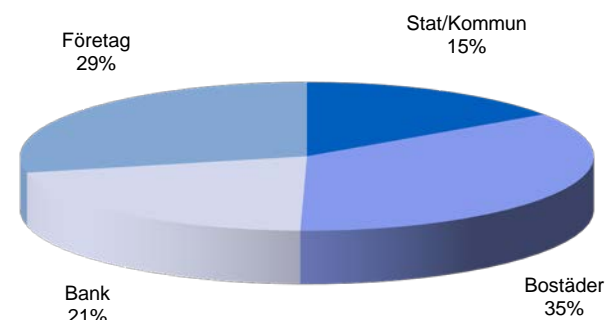
AMF RÄNTEFOND LÅNG

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

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



Placeringar i Räntefond Lång Emittentfördelning, %



Räntefond Lång

Totalt antal andelar	55 369 972
Total förmögenhet MSEK	8 367,7
Likviditet *	-11,3%
Duration	3,85
Modifierad duration	3,83%
Modifierad duration krediter	2,28%
Yield	0,40%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	3,99
Avkastning från årets början	-0,67%
Avkastning Index	-0,76%
Nav-kurs	151,12

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	17,2
SEB Bolån	10,9
SBAB	8,2
Volkswagen Finans	6,6
Swedbank hypotek	5,5
Totalt	48,4

AMF RÄNTEFOND LÅNG

Perioden 160430-210430 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	8 367,7
Avkastning - portfölj	6,8%
Avkastning - index	4,6%
Skillnad	2,2%

Riskindikator	2
Hållbarhetsbetyg	-
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	1,7%
Volatilitet - index	1,5%
Aktiv risk	0,7%
Info. kvot	0,62
Sharpekvot - portfölj	1,10
Jensens alfa	0,3%
Beta	1,09
Förklaringsgrad	85,7%
Konsistens	85,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	8 367,7	8 859,8	8 621,8	8 077,9	6 970,1	7 328,8	6 501,6
Avkastning - portfölj	-0,6%	2,0%	1,7%	1,2%	0,7%	3,3%	0,5%
Avkastning - index	-0,8%	1,4%	1,2%	1,0%	0,4%	2,8%	0,5%
Skillnad	0,2%	0,6%	0,5%	0,1%	0,3%	0,5%	0,0%

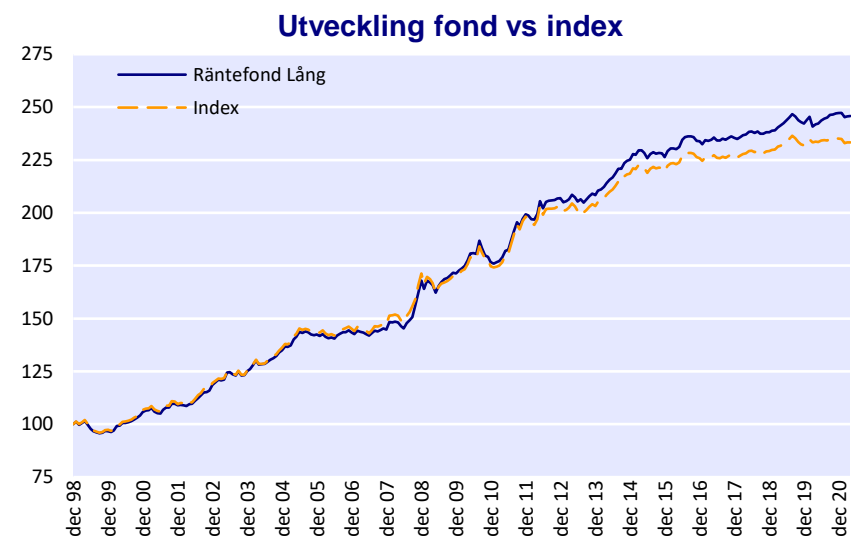
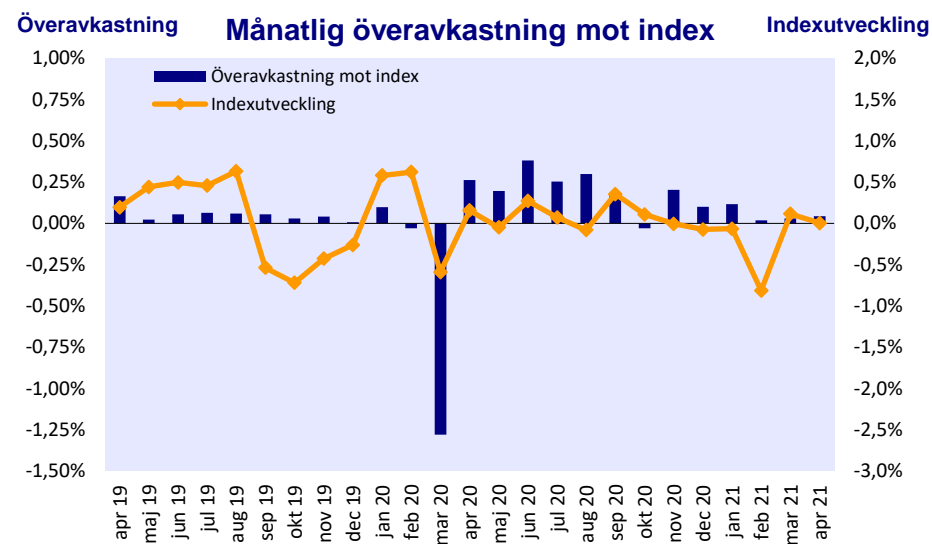
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,0%	-0,6%	-0,3%	1,6%	3,7%	6,8%	4,1%
Avkastning - index	0,0%	-0,7%	-0,8%	-0,2%	2,3%	4,6%	3,9%
Skillnad	0,0%	0,1%	0,5%	1,8%	1,4%	2,2%	0,2%

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

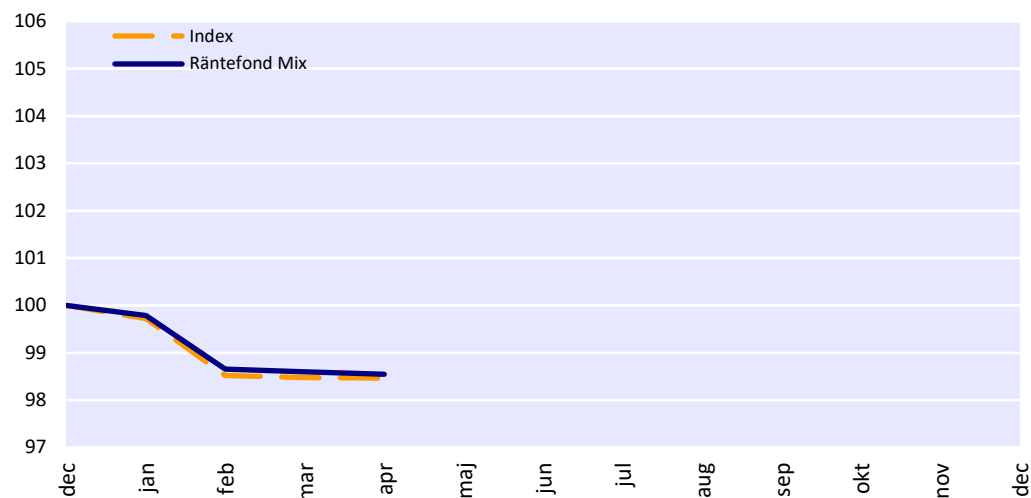
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



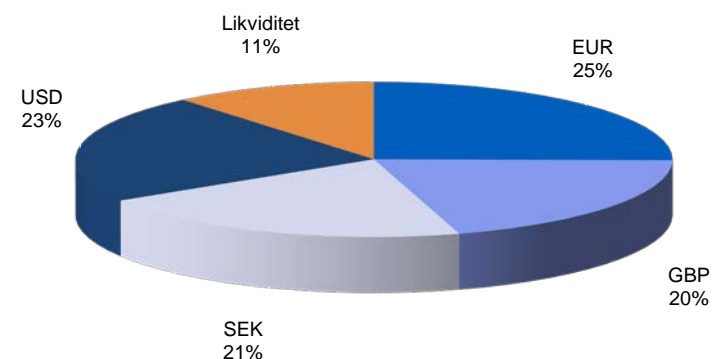
AMF RÄNTEFOND MIX

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

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



Placeringar i Räntefond Mix
Emittentfördelning, %



Räntefond Mix

Totalt antal andelar	24 938 705
Total förmögenhet MSEK	2 976,3
Likviditet *	11,1%
Duration	4,12
Modifierad duration	4,11%
Modifierad duration krediter	1,95%
Yield	0,16%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	4,07
Avkastning från årets början	-1,45%
Avkastning Index	-1,54%
Nav-kurs	119,35

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Stat USA	22,0
Stat Storbritannien	19,4
Stat Tyskland	17,2
Stat Italien	7,3
Stat Sverige	7,1
Totalt	73,0

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 160430-210430 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK)	2 976,3
Avkastning - portfölj	2,7%
Avkastning - index	1,8%
<i>Skillnad</i>	<i>0,9%</i>

Riskindikator	3
Hållbarhetsbetyg	-
Morningstar rating **	-
Volatilitet - portfölj	1,8%
Volatilitet - index	1,9%
Aktiv risk	0,3%
Info. Kvot	0,65
Sharpekvot - portfölj	0,61
Jensens alfa	0,2%
Beta	0,97
Förklaringsgrad	97,6%
Konsistens	68,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	2 976,3	3 375,6	1 790,2	1 285,9	990,9	905,7	764,1

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

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

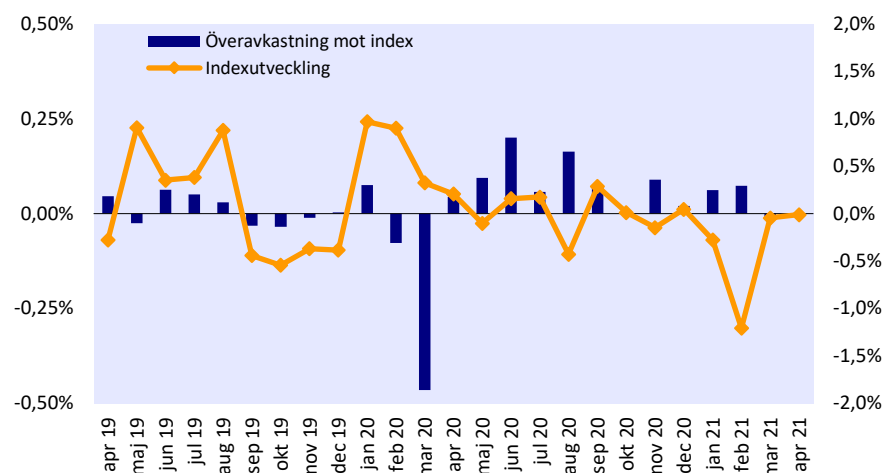
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

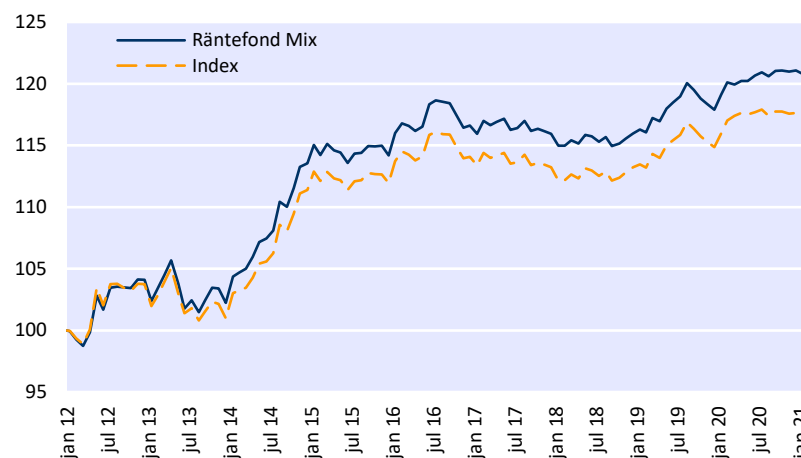
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



Utveckling fond vs index



DEFINITIONER

Avkastning	Avkastningen avser den värdeökning alternativt värdeminskning som uppstår från periodens början till dess slut, inklusive direktavkastning.
Duration	Duration är en räntefonds genomsnittliga återbetalningstid, vägd med kassaströmmarnas nuvärde.
Modifierad Duration	Modifierad duration anger hur känsligt räntefondens värde är för förändringar i räntenivån, det vill säga med hur många procent fondens värde ändras när räntenivån sjunker eller stiger med en procentenhet.
Yield	Förväntad avkastning vid oförändrad räntenivå.
Modifierad Duration Krediter	Modifierad duration på alla innehav exklusive sådana utgivna av stater.
Genomsnittlig löptid till förfall	En sammanvägning av alla innehavs löptid till slutligt förfall.
Volatilitet (<i>total risk</i>)	Volatilitet är ett riskmått, som avser spridning kring förväntad avkastning. Ett stort spridningsmått innebär hög risk och vice versa. Till exempel innebär 10% volatilitet att avkastningen med två tredjedels sannolikhet kommer att hamna inom +/- 10% från den förväntade avkastningen.
Aktiv risk (<i>Tracking Error</i>)	Den aktiva risken mäter storleken på 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.