

AMF Fonder AB - Månadsrapport

per 2021-12-31

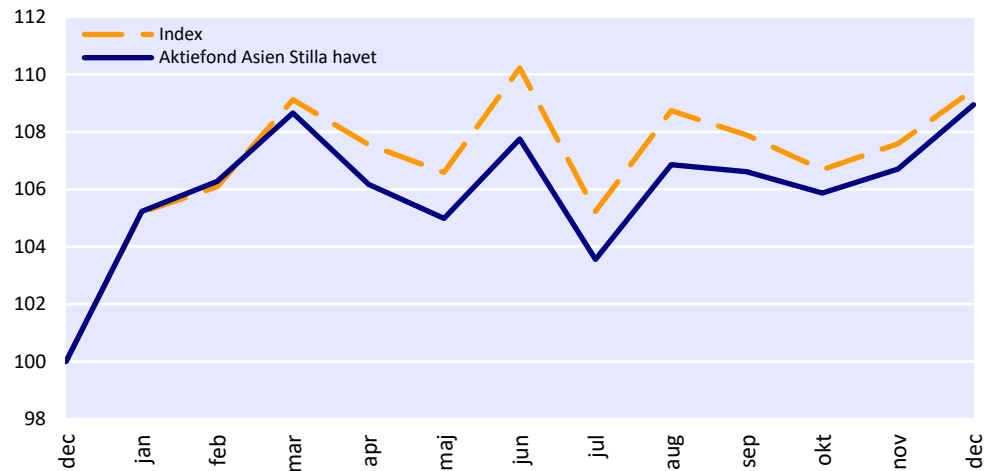


AMF Fonder AB, 113 88 Stockholm
Besöksadress: Klara Södra Kyrkogata 18
Telefon 08-696 31 00
www.amf.se
Org nr 556549-2922 Bolagets säte: Stockholm

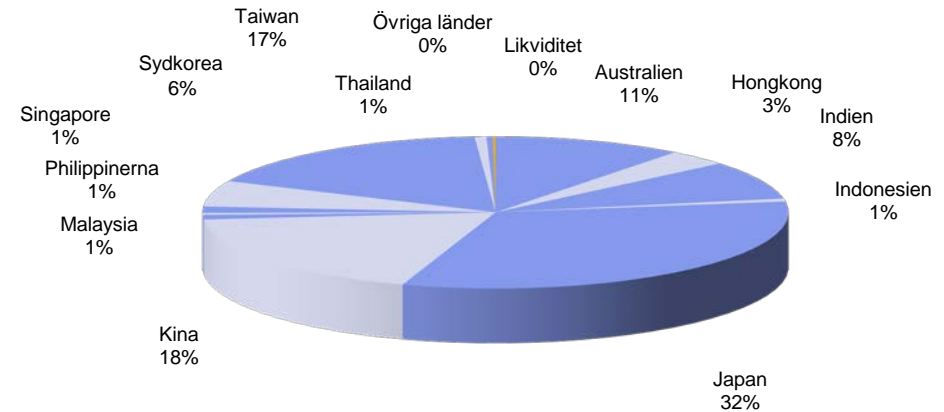
AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Asien och Stillahavsområdet.

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



Placeringar i Aktiefond Asien Stilla havet
Länderfördelning, %



Aktiefond Asien Stilla havet	
Totalt antal andelar	6 557 378
Total förmögenhet MSEK	1 921,8
Likviditet *	0,1%
Avkastning från årets början	8,94%
Avkastning Index	9,47%
Nav-kurs	293,08

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	9,6
Tencent Holdings, Kina	5,1
Sony, Japan	4,8
Alibaba Group Holding, Kina	4,2
Mediatek, Taiwan	2,7

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
HK Exch. & Cl., Hong Kong	2,6
Shin-Etsu Chemical, Japan	2,6
Chailease Holding, Taiwan	2,4
Murata Manufacturing, Japan	2,3
East Japan Railway, Japan	2,2
Totalt	38,4

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

AMF AKTIEFOND ASIEN STILLA HAVET

Perioden 161231-211231 (5 år)*	
Marknadsvärde (MSEK)	1 921,8

Avkastning - portfölj	73,7%
Avkastning - index	64,1%
Skillnad	9,6%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	11,9%
Volatilitet - index	12,0%
Aktiv risk	1,4%
Info. Kvot	0,90
Sharpekvot - portfölj	1,02
Jensens alfa	1,4%
Beta	0,99
Förklaringsgrad	98,6%
Konsistens	61,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	1 921,8	1 801,9	1 305,1	918,9	979,3	1 584,8	1 319,4

Avkastning - portfölj	8,9%	12,3%	28,3%	-5,6%	17,2%	11,1%	6,5%
Avkastning - index	9,5%	6,4%	28,5%	-6,8%	17,6%	13,1%	8,1%
Skillnad	-0,5%	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	2,1%	2,2%	1,1%	8,9%	57,0%	73,7%	9,2%
Avkastning - index	1,8%	1,5%	-0,7%	9,5%	49,7%	64,1%	9,5%
Skillnad	0,3%	0,7%	1,8%	-0,5%	7,3%	9,6%	-0,3%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

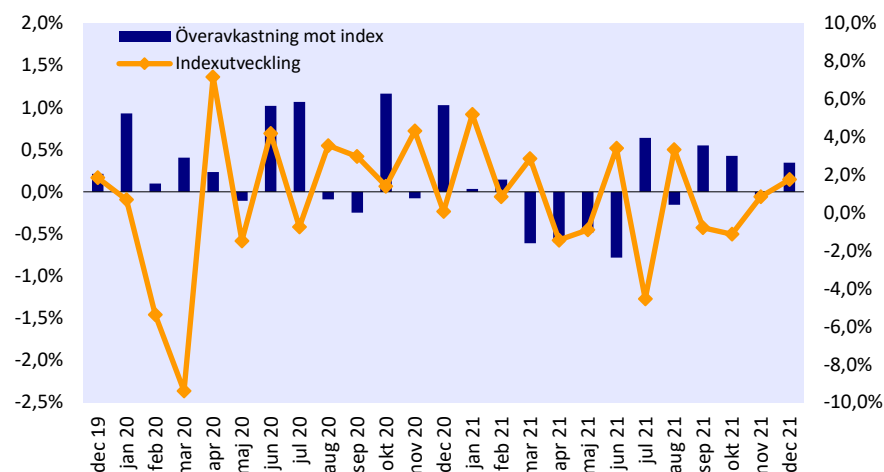
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

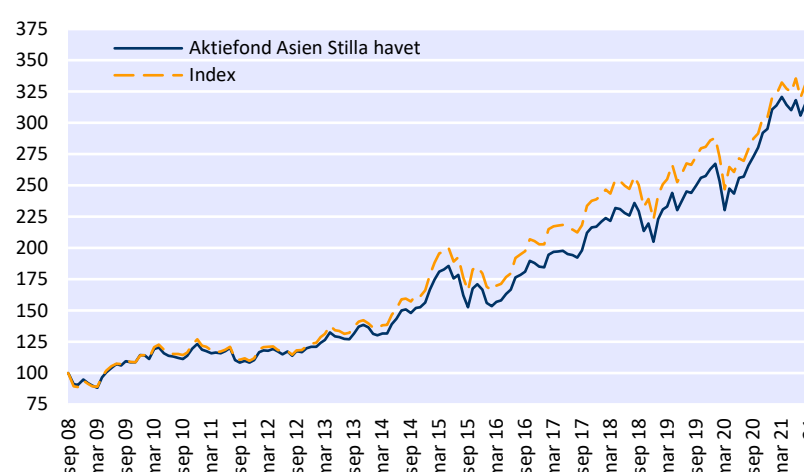
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



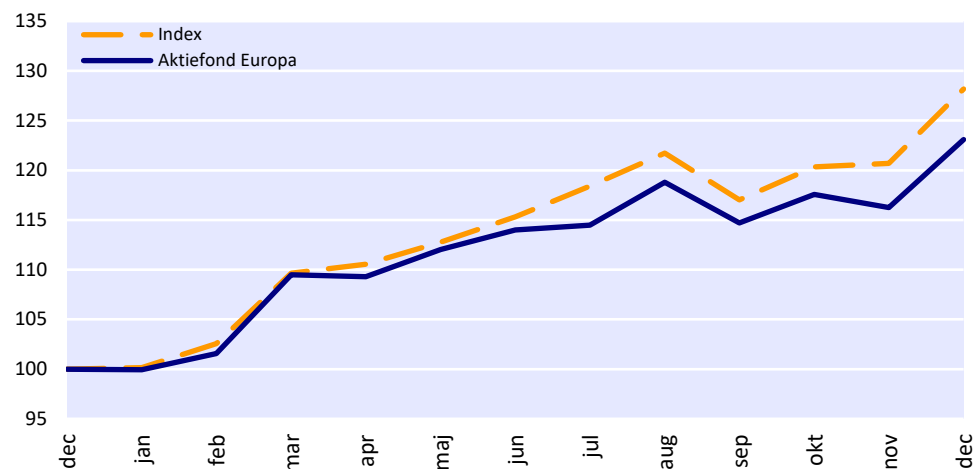
Utveckling fond vs index



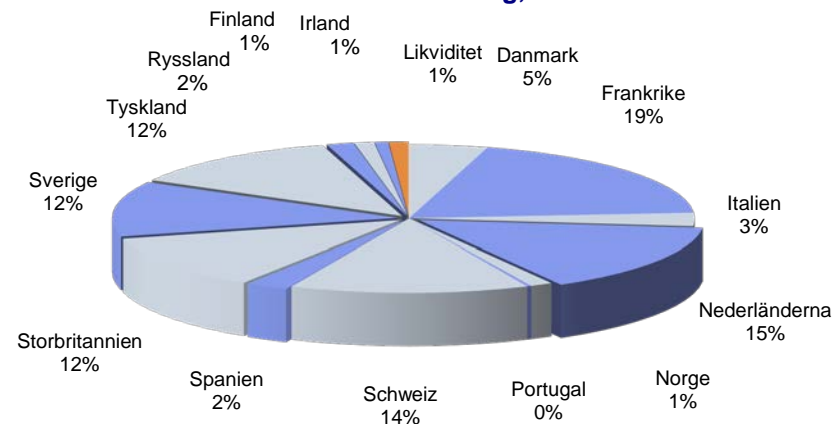
AMF AKTIEFOND EUROPA

Fonden placerar i marknadsnoterade aktier i Europa.

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



Placeringar i Aktiefond Europa
Länderfördelning, %



Aktiefond Europa	
Totalt antal andelar	24 281 931
Total förmögenhet MSEK	6 909,5
Likviditet *	1,1%
Avkastning från årets början	23,09%
Avkastning Index	28,18%
Nav-kurs	284,55

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
ASML, Nederländerna	5,6
AstraZeneca, Sverige	4,8
Roche, Schweiz	4,5
SAP, Tyskland	3,6
Allianz, Tyskland	3,5

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Novo Nordisk, Danmark	3,1
Air Liquide, Frankrike	3,0
Enel, Italien	2,9
Lloyds, Storbritannien	2,7
ING, Nederländerna	2,5
Totalt	36,1

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

AMF AKTIEFOND EUROPA

Perioden 161231-211231 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	6 909,5
Avkastning - portfölj	64,7%
Avkastning - index	69,5%
Skillnad	-4,8%
Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	14,5%
Volatilitet - index	14,1%
Aktiv risk	2,6%
Info. kvot	-0,24
Sharpekvot - portfölj	0,76
Jensens alfa	-0,8%
Beta	1,01
Förklaringsgrad	96,8%
Konsistens	55,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	6 909,5	5 480,6	5 611,9	4 362,4	5 558,7	4 162,5	4 157,7
Avkastning - portfölj	23,1%	1,1%	29,6%	-8,9%	12,1%	7,0%	6,4%
Avkastning - index	28,2%	-4,8%	32,5%	-6,2%	11,8%	5,6%	4,7%
Skillnad	-5,1%	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	5,9%	7,3%	8,0%	23,1%	61,3%	64,7%	6,6%
Avkastning - index	6,2%	9,5%	11,2%	28,2%	61,6%	69,5%	5,2%
Skillnad	-0,3%	-2,2%	-3,2%	-5,1%	-0,3%	-4,8%	1,4%

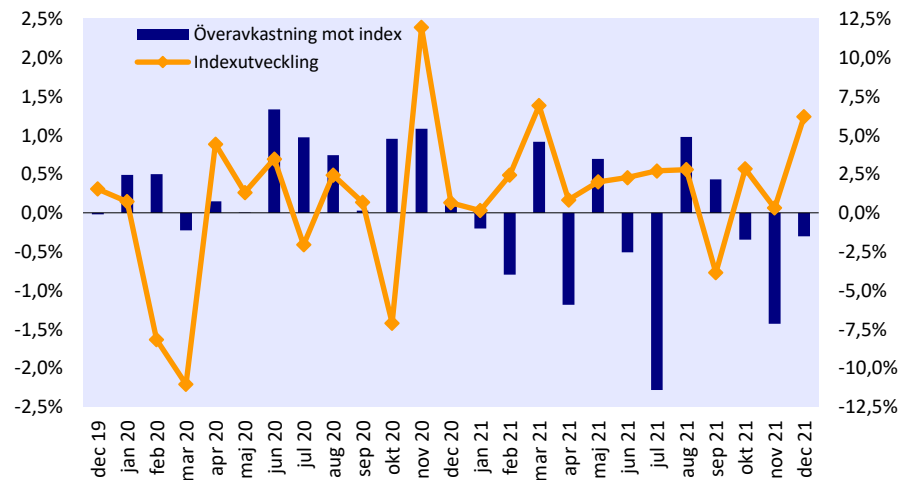
Referensindex: MSCI ACWI ESG Leaders Europe NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

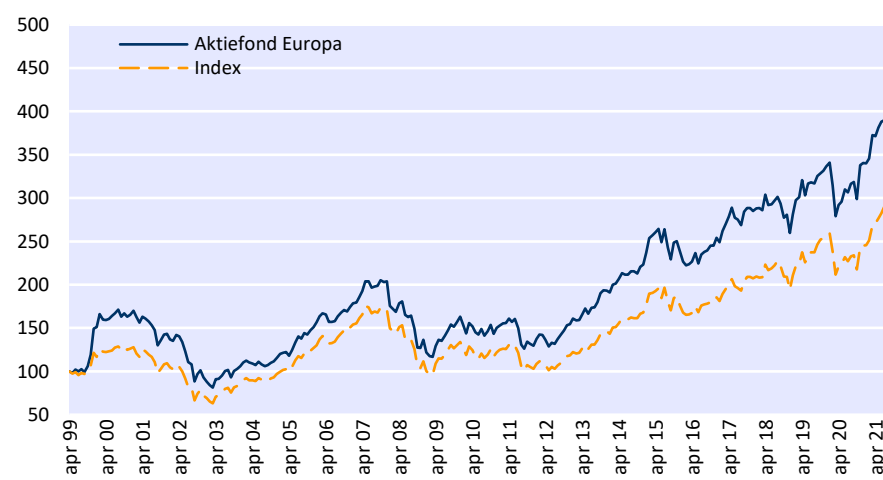
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



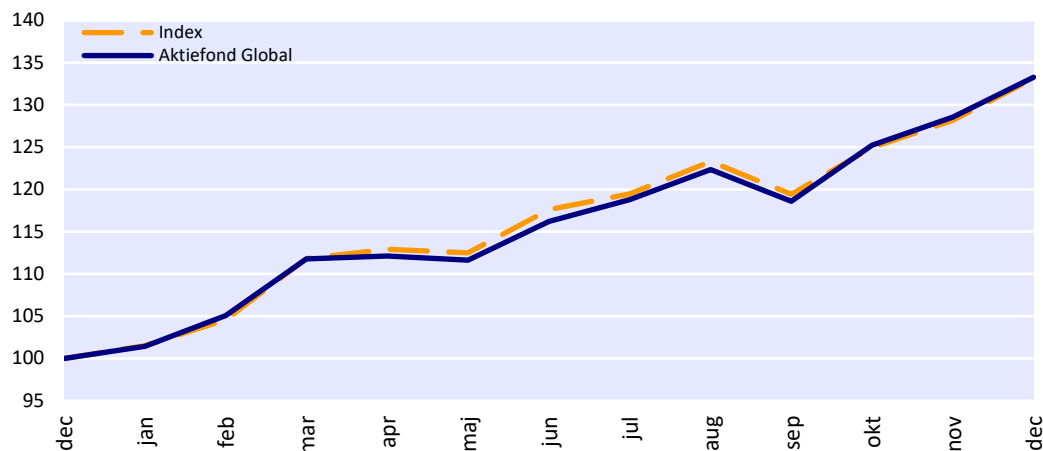
Utveckling fond vs index



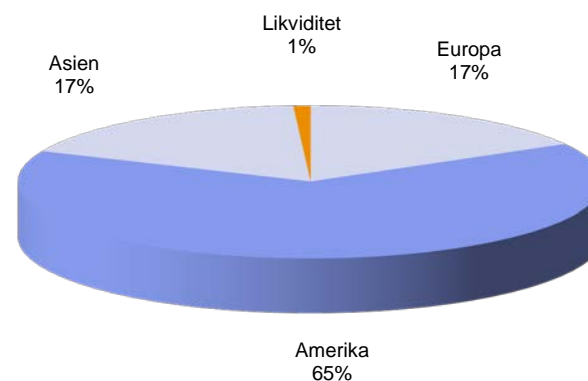
AMF AKTIEFOND GLOBAL

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

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



Placeringar i Aktiefond Global
Länderfördelning, %



Aktiefond Global	
Totalt antal andelar	94 792 053
Total förmögenhet MSEK	27 858,4
Likviditet *	1,0%
Avkastning från årets början	33,29%
Avkastning Index	33,17%
Nav-kurs	293,89

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft, USA	8,6
Alphabet, USA	6,6
Procter & Gamble, USA	3,8
Berkshire Hathaway, USA	2,9
Taiwan Semic. Manuf., Taiwan	2,5

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
AstraZeneca, Sverige	2,5
Tesla, USA	2,4
Nvidia, USA	1,9
Waste Management, USA	1,8
Lloyds, Storbritannien	1,6
Totalt	34,5

AMF AKTIEFOND GLOBAL

Perioden 161231-211231 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	27 858,4

Avkastning - portfölj	105,7%
Avkastning - index	99,7%
Skillnad	6,0%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	12,8%
Volatilitet - index	13,5%
Aktiv risk	1,6%
Info. kvot	0,42
Sharpekvot - portfölj	1,25
Jensens alfa	1,5%
Beta	0,94
Förklaringsgrad	98,7%
Konsistens	48,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	27 858,4	19 221,8	17 424,4	3 657,2	3 522,8	3 188,1	2 507,6

Avkastning - portfölj	33,3%	5,2%	34,7%	-1,1%	10,1%	15,6%	6,7%
Avkastning - index	33,2%	1,8%	34,3%	-1,1%	10,9%	16,2%	5,6%
Skillnad	0,1%	3,5%	0,4%	0,0%	-0,8%	-0,6%	1,1%

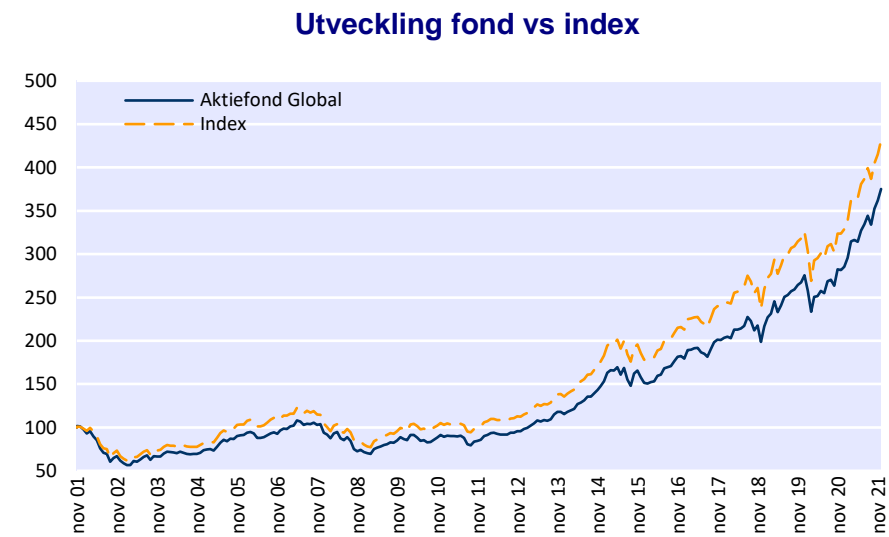
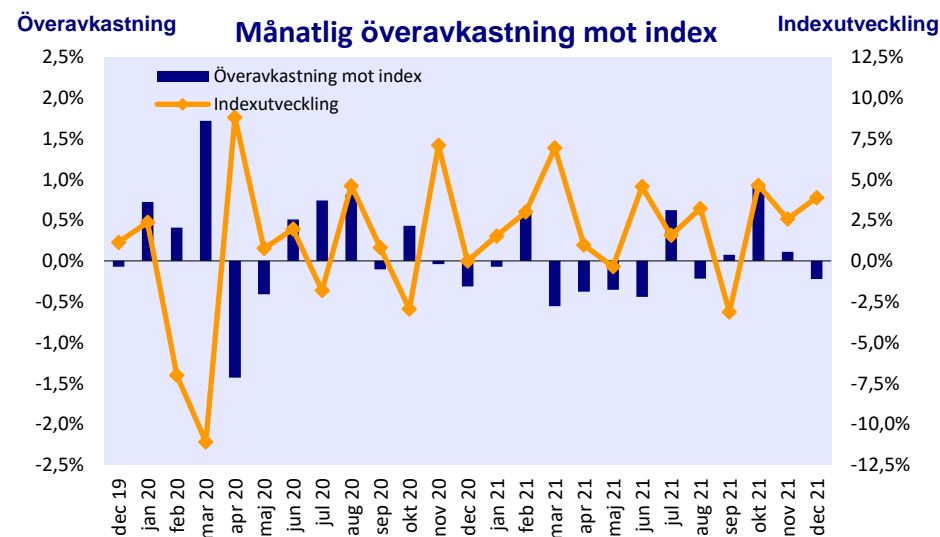
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	3,7%	12,4%	14,7%	33,3%	88,9%	105,7%	6,8%
Avkastning - index	3,9%	11,5%	13,2%	33,2%	82,0%	99,7%	7,5%
Skillnad	-0,2%	0,9%	1,5%	0,1%	6,9%	6,0%	-0,7%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

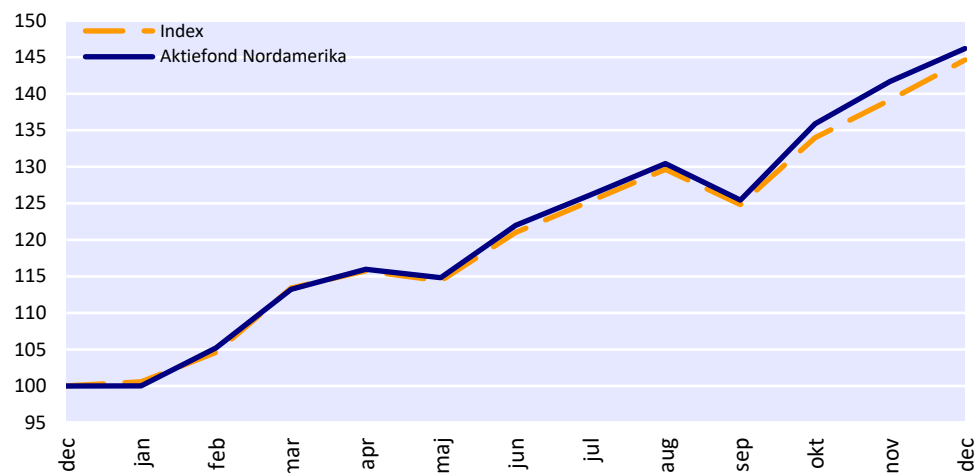
***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



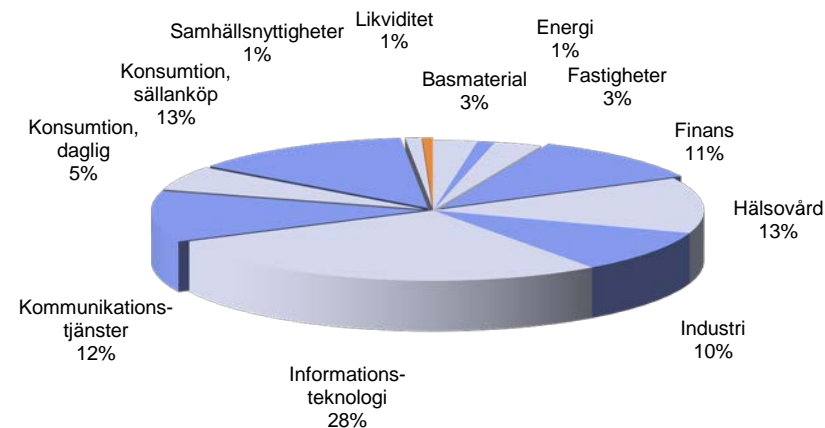
AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

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

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



Placeringar i Aktiefond Nordamerika
branschfördelning, %



Aktiefond Nordamerika	
Totalt antal andelar	10 841 276
Total förmögenhet MSEK	5 265,0
Likviditet *	0,6%
Avkastning från årets början	46,18%
Avkastning Index	44,62%
Nav-kurs	485,65

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Microsoft	9,5
Alphabet	9,4
Tesla	4,0
Nvidia	3,7
Procter & Gamble	2,6

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Visa	2,5
Thermo Fischer Scientific	2,4
Eli Lilly & Company	2,3
Salesforce	2,2
McDonald's	2,1
Totalt	40,8

AMF AKTIEFOND NORDAMERIKA

Perioden 161231-211231 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 5 265,0

Avkastning - portfölj 142,6%
 Avkastning - index 133,5%
 Skillnad 9,2%

Riskindikator 6
 Hållbarhetsbetyg 5
 Morningstar rating ** 5
 Volatilitet - portfölj 14,8%
 Volatilitet - index 15,0%
 Aktiv risk 1,6%
 Info. Kvot 0,57
 Sharpekvot - portfölj 1,35
 Jensens alfa 1,3%
 Beta 0,98
 Förklaringsgrad 98,9%
 Konsistens 50,0%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	5 265,0	2 761,4	2 826,5	1 808,6	1 528,3	1 751,1	1 267,5

Avkastning - portfölj	46,2%	6,2%	39,0%	5,3%	6,9%	18,7%	10,1%
Avkastning - index	44,6%	3,7%	38,2%	4,3%	8,0%	19,6%	8,1%
Skillnad	1,6%	2,5%	0,7%	1,0%	-1,1%	-0,9%	2,0%

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	3,2%	16,6%	19,9%	46,2%	115,7%	142,6%	12,4%
Avkastning - index	3,9%	15,9%	19,5%	44,6%	107,3%	133,5%	13,1%
Skillnad	-0,8%	0,7%	0,4%	1,6%	8,4%	9,2%	-0,7%

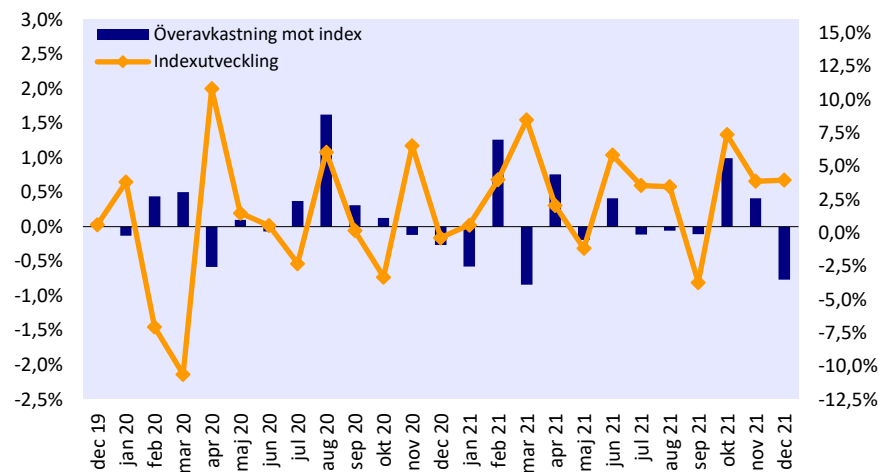
Referensindex: MSCI ESG Leaders USA NR (omräkn.sek)

* Alla värden beräknas inkl avgifter

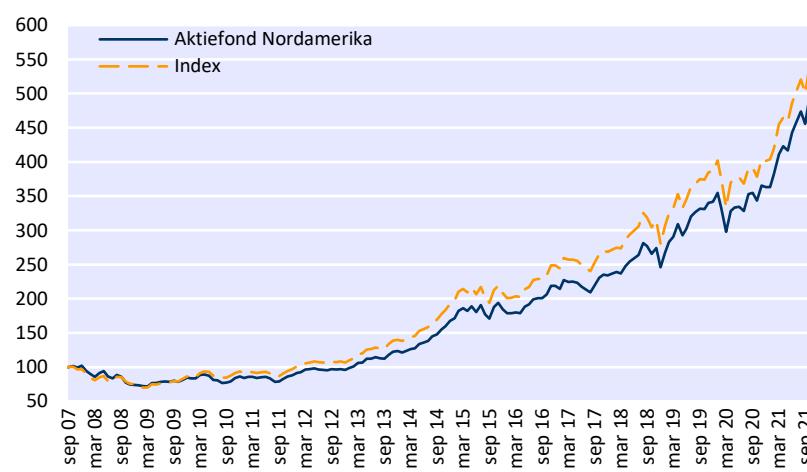
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



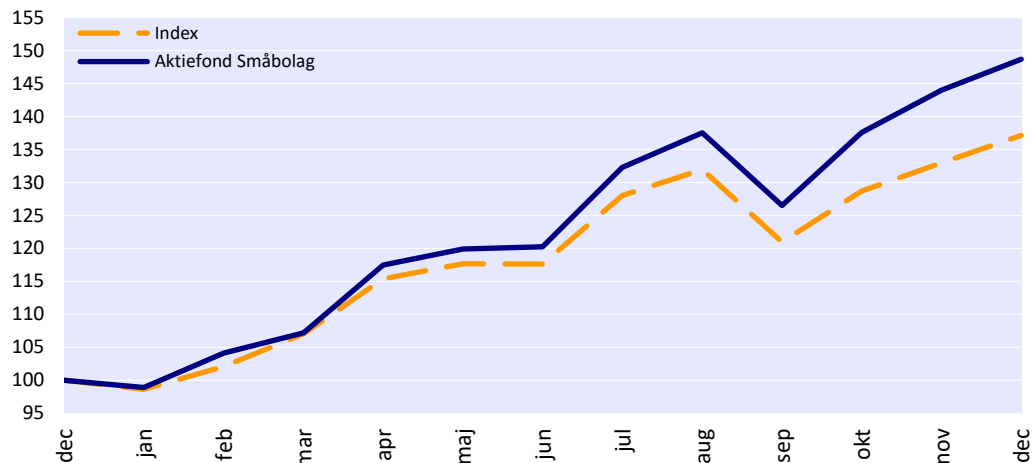
Utveckling fond vs index



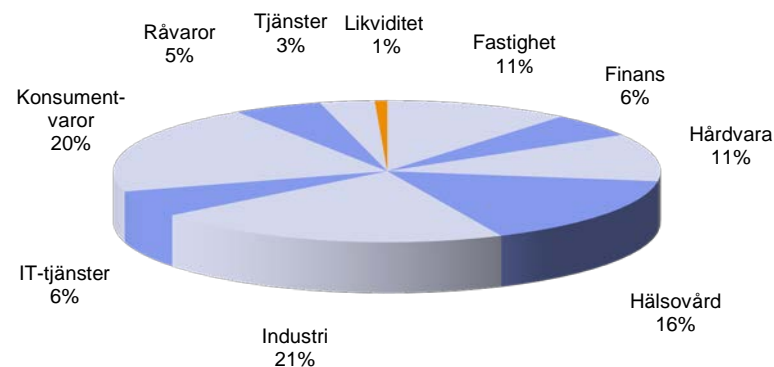
AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

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

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



Placeringar i Aktiefond Småbolag
Branschfördelning, %



Aktiefond Småbolag	
Totalt antal andelar	16 814 569
Total förmögenhet MSEK	29 223,5
Likviditet *	0,7%
Avkastning från årets början	48,69%
Avkastning index	37,14%
Nav-kurs	1737,99

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Medicover	3,4
Hexatronic	3,2
AddLife	3,1
Mips	2,9
Avanza	2,9

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Beijer Ref	2,7
NCAB	2,6
Sweco	2,6
SwedenCare	2,5
Trelleborg	2,5
Totalt	28,3

AMF AKTIEFOND SMÅBOLAG

Perioden 161231-211231 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	29 223,5
Avkastning - portfölj	219,4%
Avkastning - index	162,3%
Skillnad	57,1%
Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	4
Volatilitet - portfölj	17,9%
Volatilitet - index	18,0%
Aktiv risk	4,0%
Info. kvot	1,23
Sharpekvot - portfölj	1,49
Jensens alfa	5,1%
Beta	0,99
Förklaringsgrad	95,0%
Konsistens	63,3%

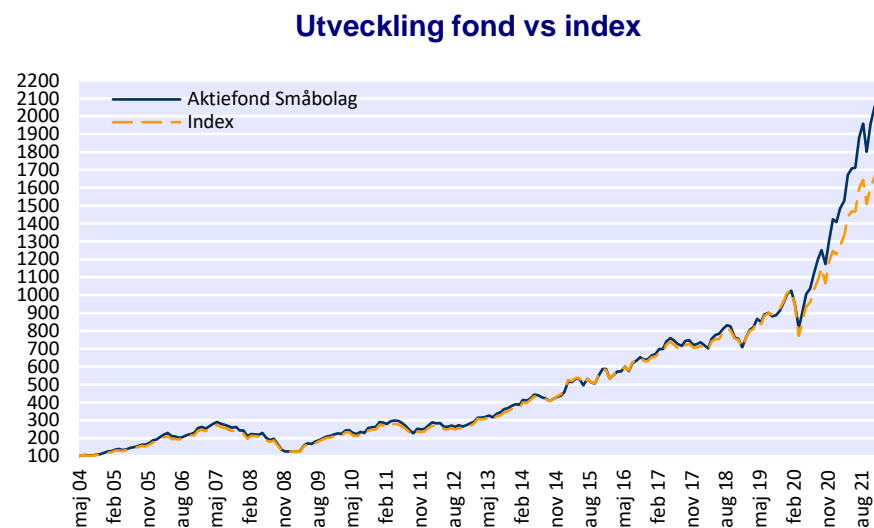
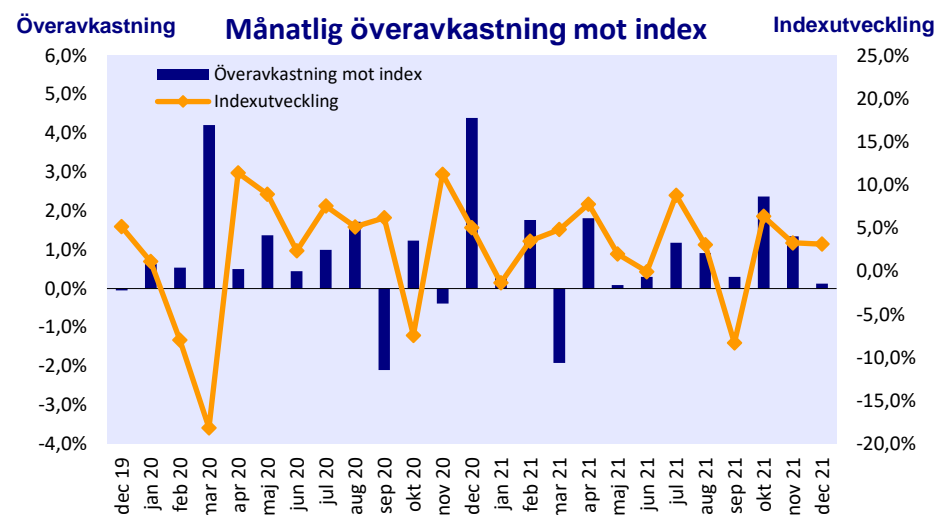
	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	29 223,5	16 069,7	9 803,5	6 723,3	7 358,6	6 492,9	5 666,5
Avkastning - portfölj	48,7%	41,5%	42,2%	-2,6%	9,6%	13,0%	34,2%
Avkastning - index	37,1%	23,0%	43,2%	-0,2%	8,8%	12,2%	30,1%
Skillnad	11,5%	18,5%	-1,0%	-2,4%	0,8%	0,9%	4,2%
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	3,3%	17,5%	23,7%	48,7%	199,1%	219,4%	18,9%
Avkastning - index	3,1%	13,3%	16,6%	37,1%	141,5%	162,3%	17,5%
Skillnad	0,1%	4,2%	7,1%	11,5%	57,6%	57,1%	1,4%

Referensindex: Carnegie Small Cap Return Sweden

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadskifte

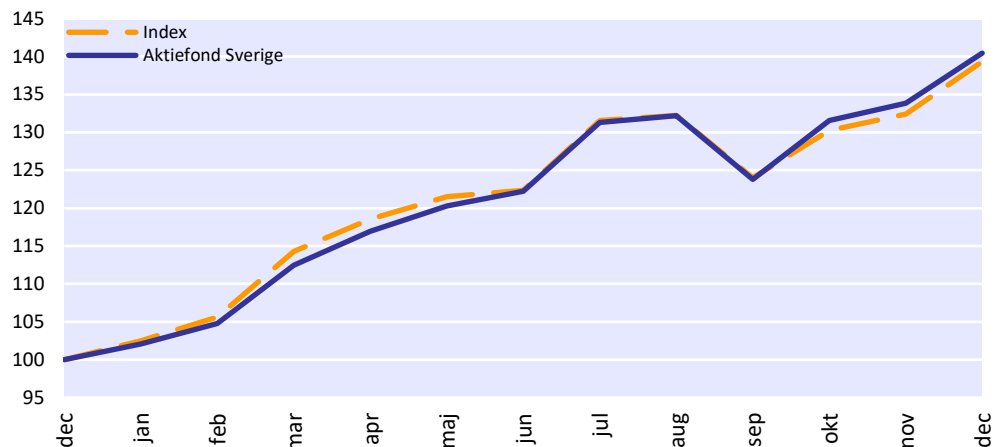
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



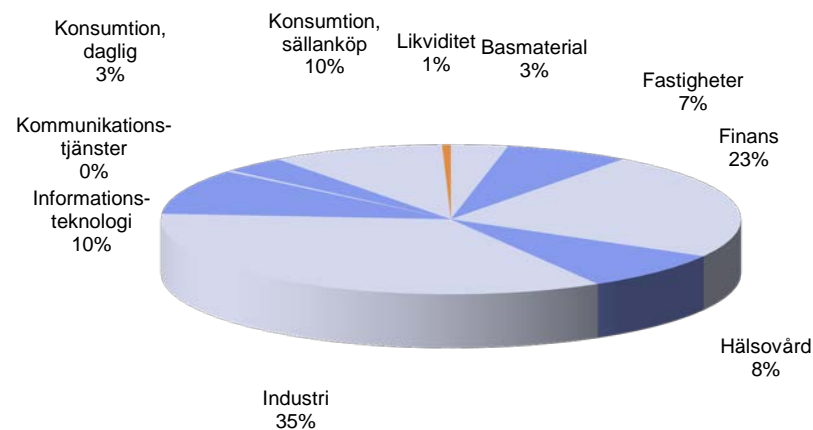
AMF AKTIEFOND SVERIGE

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

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



Placeringar i Aktiefond Sverige
Branschfördelning, %



Aktiefond Sverige	
Totalt antal andelar	49 314 410
Total förmögenhet MSEK	50 893,7
Likviditet *	0,5%
Avkastning från årets början	40,46%
Avkastning Index	39,34%
Nav-kurs	1032,02

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: SIXPRX

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Epiroc	4,1
Indutrade	4,0
Essity	3,5
Latour	3,4
Nibe	3,0
Totalt	49,3

AMF AKTIEFOND SVERIGE

Perioden 161231-211231 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	50 893,7

Avkastning - portfölj	102,4%
Avkastning - index	126,6%
<i>Skillnad</i>	-24,2%

Riskindikator	6
Hållbarhetsbetyg	4
Morningstar rating **	3
Volatilitet - portfölj	15,7%
Volatilitet - index	15,5%
Aktiv risk	1,9%
Info. kvot	-1,41
Sharpekvot - portfölj	1,00
Jensens alfa	-2,6%
Beta	1,00
Förklaringsgrad	98,6%
Konsistens	33,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	50 893,7	37 056,3	33 846,3	25 371,6	27 691,6	27 500,3	26 529,6

Avkastning - portfölj	40,5%	11,7%	25,7%	-4,9%	7,9%	8,6%	8,6%
Avkastning - index	39,3%	14,8%	35,0%	-4,6%	10,0%	9,2%	6,3%
<i>Skillnad</i>	1,1%	-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	5,0%	13,5%	14,9%	40,5%	97,2%	102,4%	12,7%
Avkastning - index	5,2%	12,4%	13,9%	39,3%	116,0%	126,6%	11,1%
<i>Skillnad</i>	-0,3%	1,1%	1,0%	1,1%	-18,8%	-24,2%	1,7%

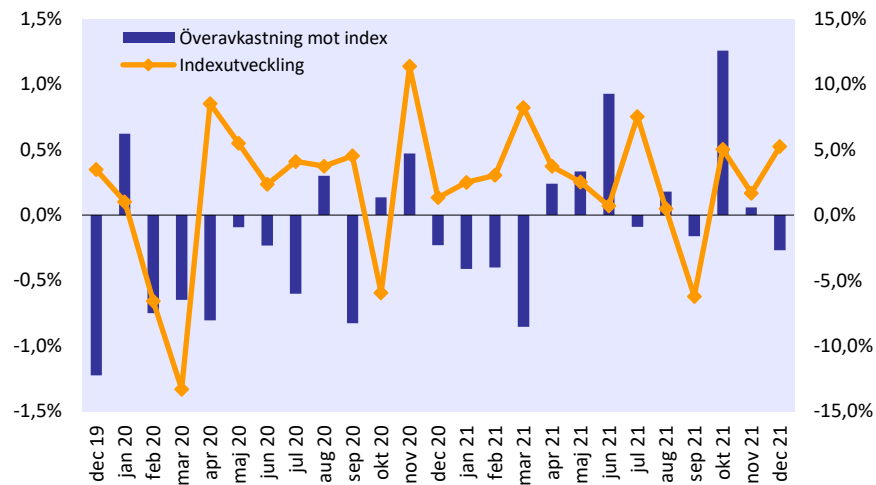
Referensindex: SIXPRX

* Alla värden beräknas inkl avgifter

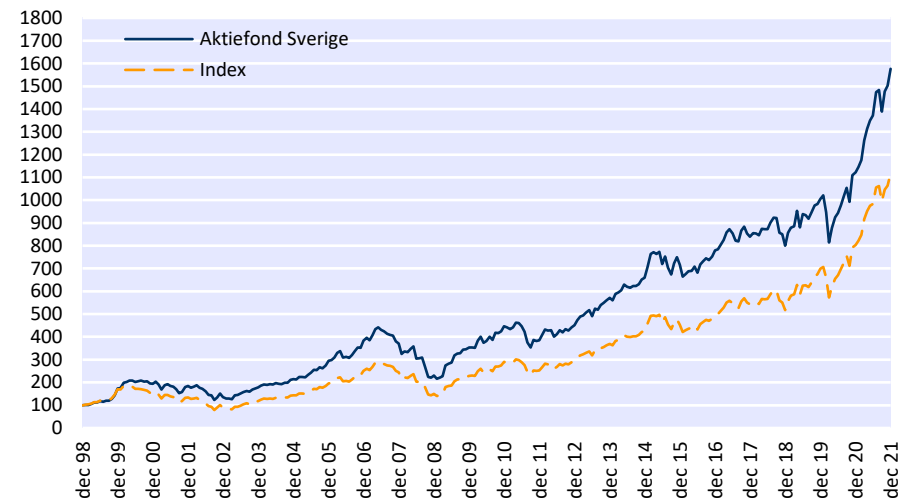
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



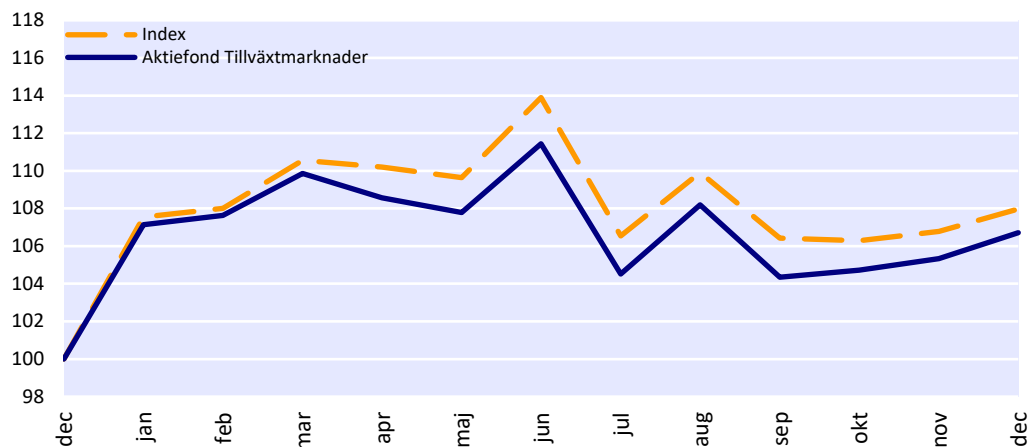
Utveckling fond vs index



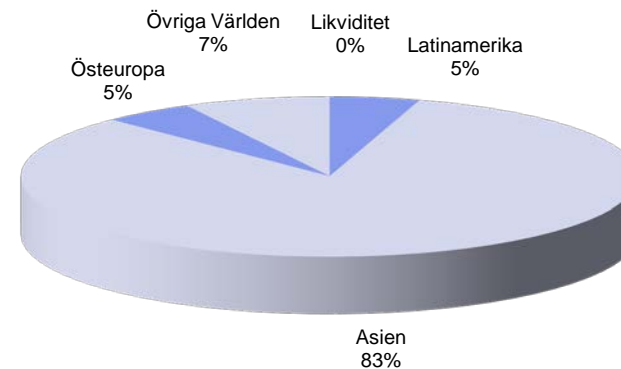
AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

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

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



Placeringar i Aktiefond Tillväxtmarknader
Regionfördelning, %



Aktiefond Tillväxtmarknader	
Totalt antal andelar	16 866 036
Total förmögenhet MSEK	2 026,9
Likviditet *	0,0%
Avkastning från årets början	6,71%
Avkastning Index	7,97%
Nav-kurs	120,17

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

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

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Chailease Holding, Taiwan	2,5
Infosys, Indien	2,5
Meituan Dianping, Kina	2,4
Samsung, Korea	1,7
China Construction Bank, Kina	1,7
	40,8

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

AMF AKTIEFOND TILLVÄXTMARKNADER

Perioden 191211-211231 ^{1),2)}	
Marknadsvärde (MSEK)	2 026,9
Avkastning - portfölj	20,2%
Avkastning - index	18,8%
<i>Skillnad</i>	1,4%

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⁾	52,0%

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

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

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

¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

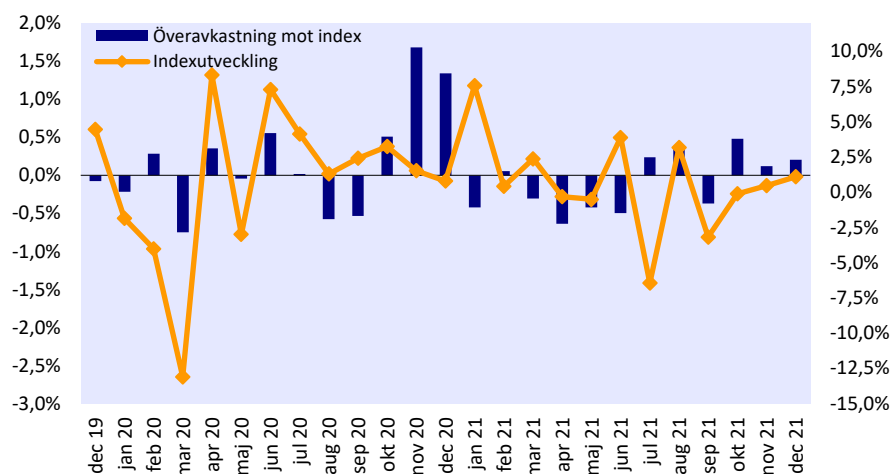
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

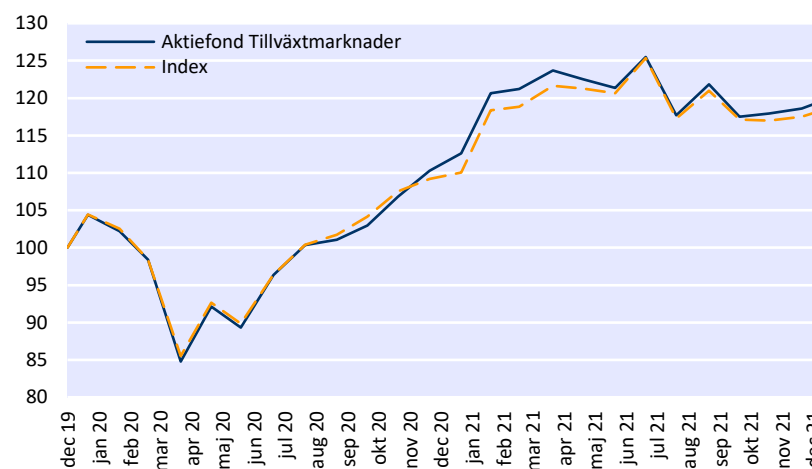
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



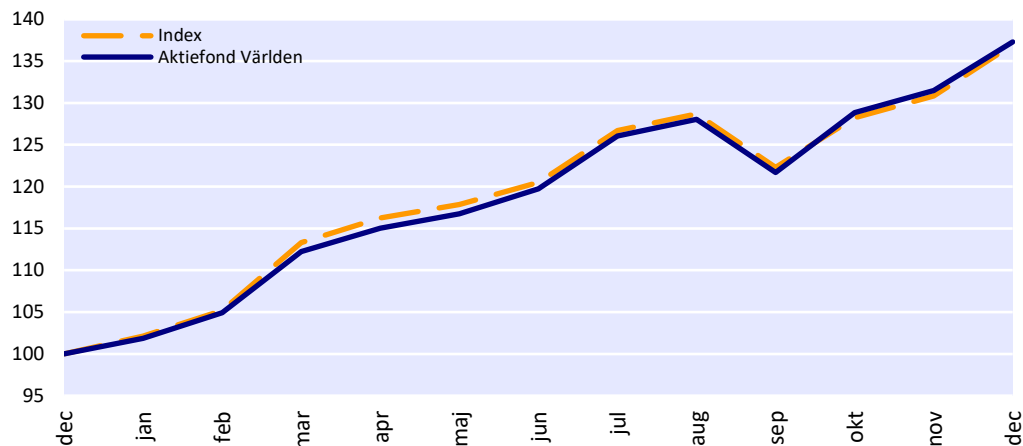
Utveckling fond vs index



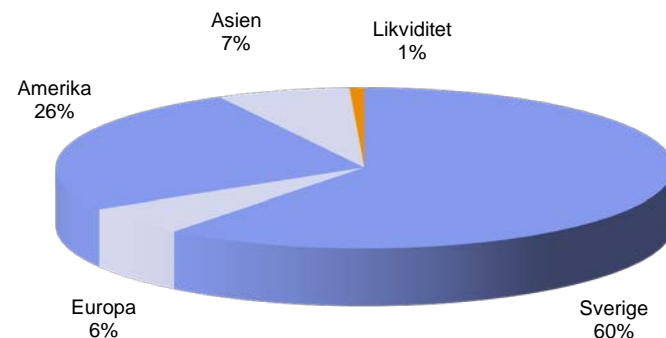
AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

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

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



Placeringar i Aktiefond Världen
Regionfördelning, %



Aktiefond Världen	
Totalt antal andelar	82 696 285
Total förmögenhet MSEK	54 930,0
Likviditet *	0,8%
Avkastning från årets början	37,30%
Avkastning Index	36,98%
Nav-kurs	664,24

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	5,7
Atlas Copco	3,5
Microsoft, USA	3,4
SEB	3,1
Volvo	2,9

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
AstraZeneca	2,7
Alphabet, USA	2,6
Hexagon	2,6
Epiroc	2,4
Indutrade	2,4
Totalt	31,2

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

AMF AKTIEFOND VÄRLDEN

Perioden 161231-211231 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	54 930,0

Avkastning - portfölj	98,0%
Avkastning - index	116,4%
Skillnad	-18,3%

Riskindikator	5
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	3
Volatilitet - portfölj	14,1%
Volatilitet - index	14,1%
Aktiv risk	1,4%
Info. kvot	-1,42
Sharpekvot - portfölj	1,07
Jensens alfa	-1,9%
Beta	0,99
Förklaringsgrad	99,0%
Konsistens	36,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	54 930,0	41 075,8	39 160,8	31 486,5	33 731,8	32 024,0	29 410,8

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

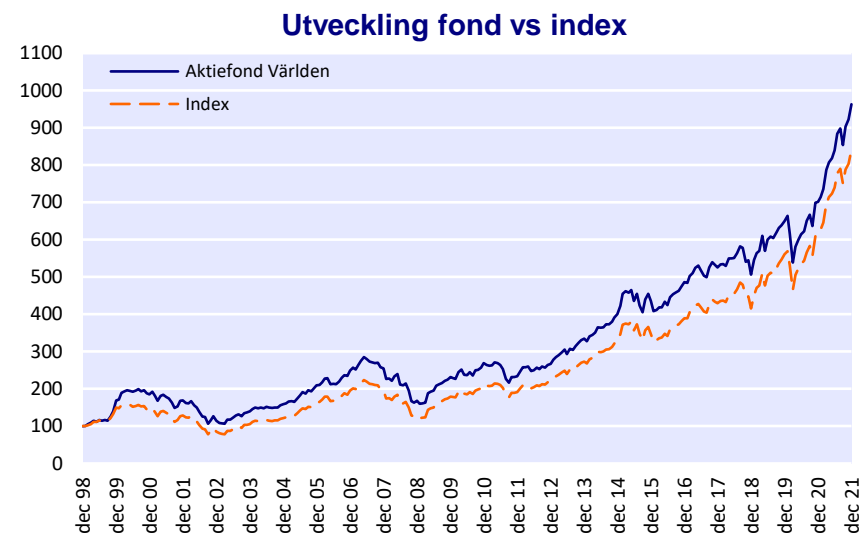
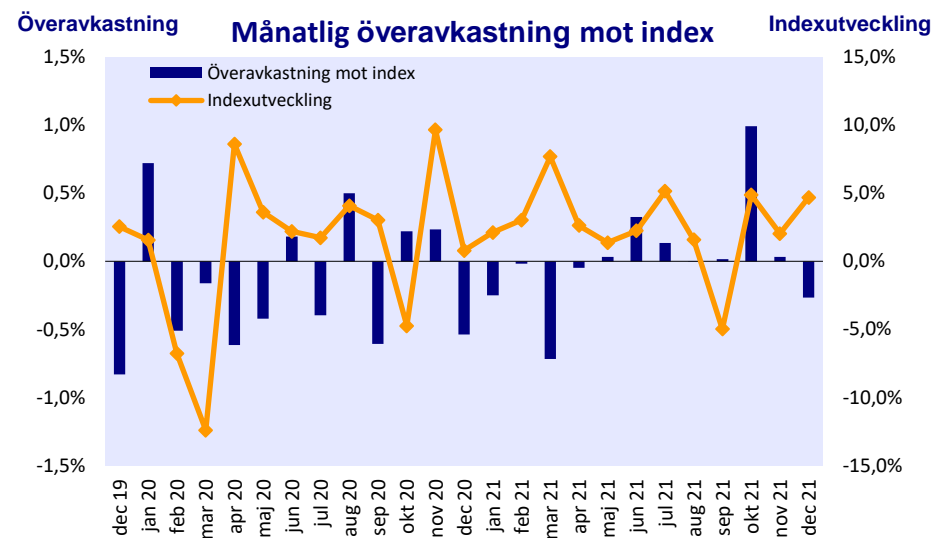
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	4,4%	12,8%	14,7%	37,3%	90,3%	98,0%	10,3%
Avkastning - index	4,7%	12,0%	13,7%	37,0%	102,2%	116,4%	9,7%
Skillnad	-0,3%	0,8%	1,0%	0,3%	-12,0%	-18,3%	0,6%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

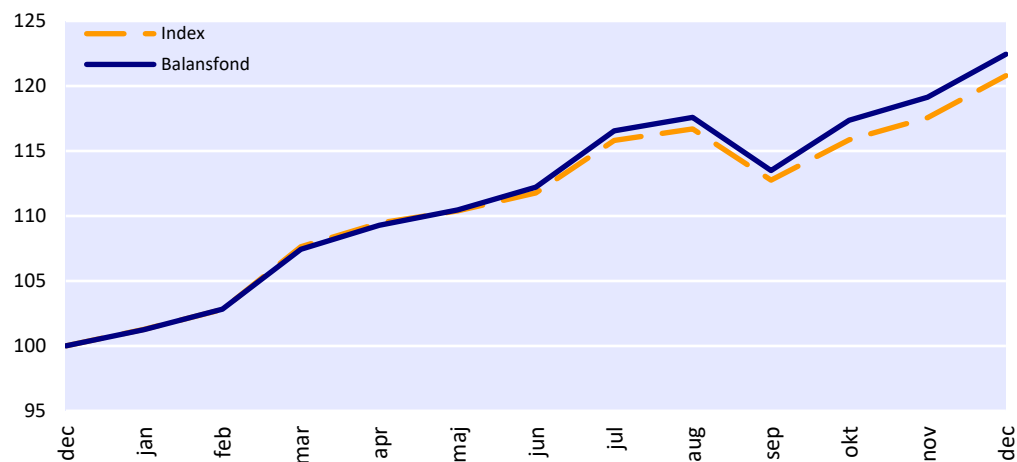
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



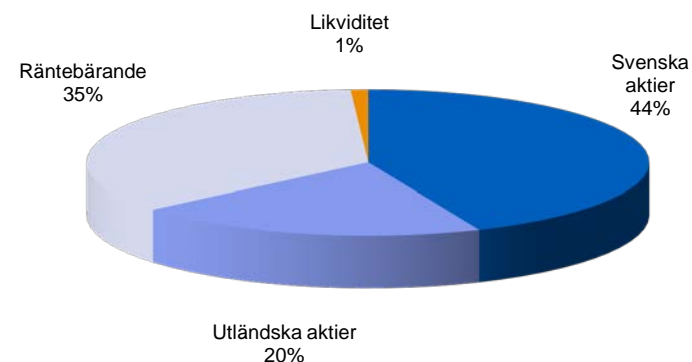
AMF BALANSFOND

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	72 890 154
Total förmögenhet MSEK	29 242,7
Likviditet *	1,0%
Modifierad duration	3,74%
Avkastning från årets början	22,44%
Avkastning Index	20,79%
Nav-kurs	401,19

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största aktieinnehav	Portföljandel, %
Investor	4,2
Atlas Copco	2,7
SEB	2,3
Volvo	2,1
Hexagon	1,9
Totalt	13,2

Största ränteb. Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	6,8
SBAB	3,4
SEB Bolån	2,7
Castellum	2,0
Klarna Bank	2,0
Totalt	17,0

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

AMF BALANSFOND

Perioden 161231-211231 (5 år) *	
Marknadsvärde (MSEK)	29 242,7

Avkastning - portfölj	56,4%
Avkastning - index	63,7%
Skillnad	-7,3%

Riskindikator	4
Hållbarhetsbetyg	5
Morningstar rating **	5
Volatilitet - portfölj	9,0%
Volatilitet - index	8,6%
Aktiv risk	1,0%
Info. kvot	-0,97
Sharpekvot - portfölj	1,09
Jensens alfa	-1,4%
Beta	1,04
Förklaringsgrad	98,8%
Konsistens	38,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	29 242,7	23 820,1	23 265,8	20 513,5	21 734,7	21 288,0	20 303,8

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

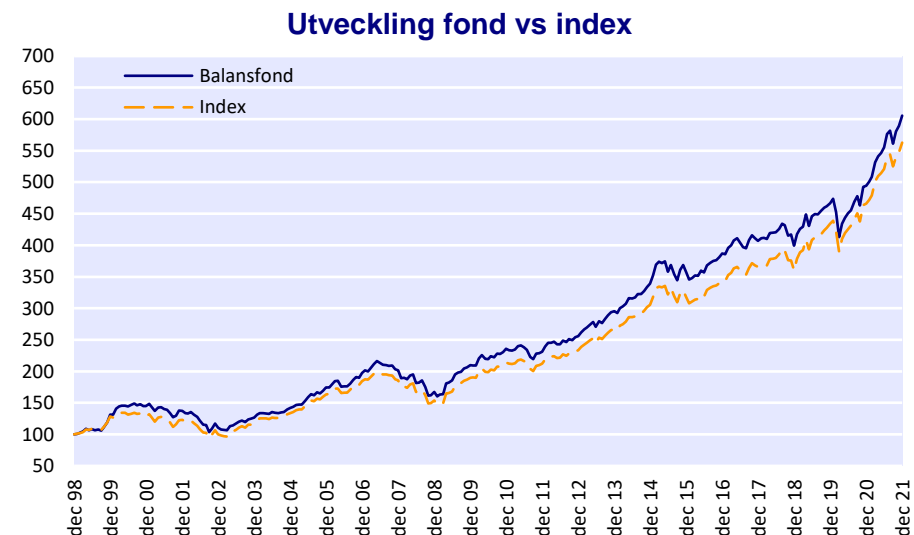
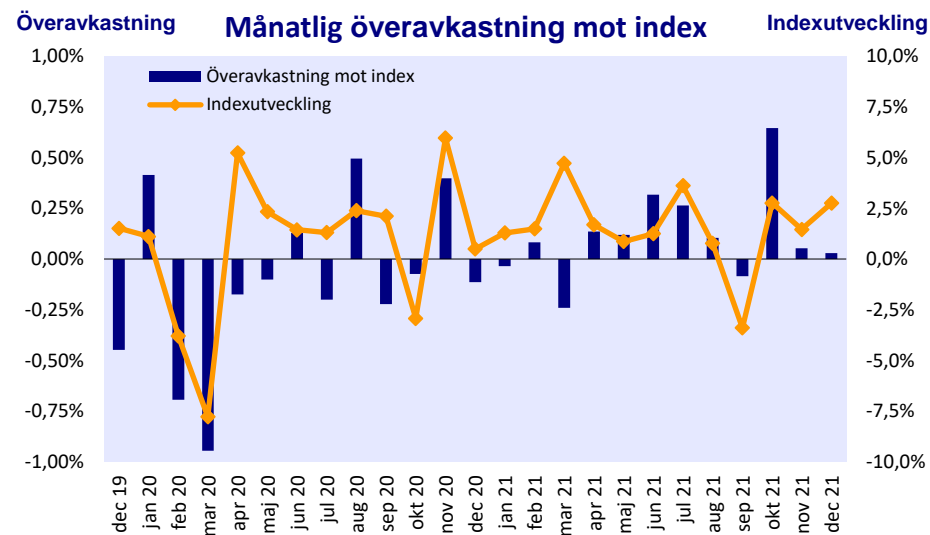
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	2,8%	7,9%	9,1%	22,4%	51,6%	56,4%	8,1%
Avkastning - index	2,8%	7,1%	8,1%	20,8%	56,2%	63,7%	7,8%
Skillnad	0,0%	0,8%	1,1%	1,6%	-4,6%	-7,3%	0,3%

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

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

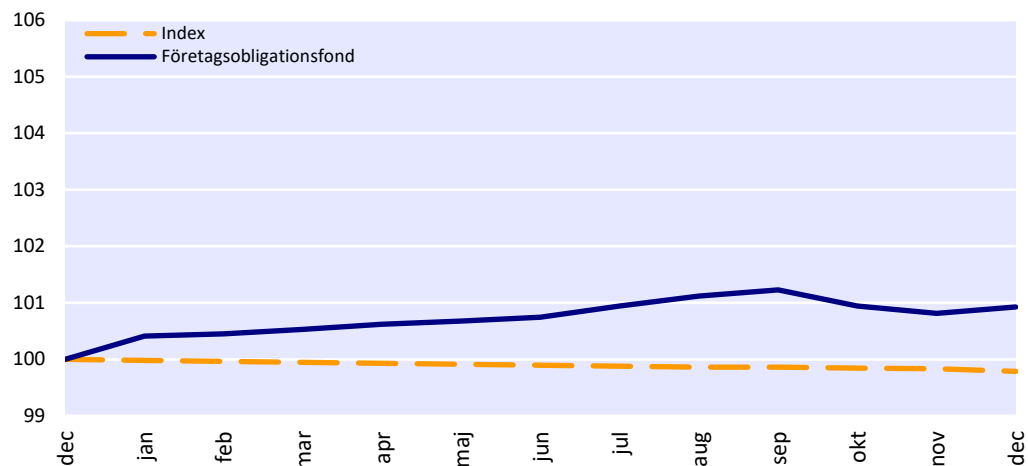
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



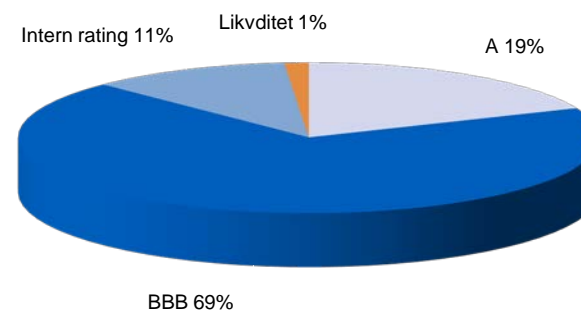
AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

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

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



Placeringar i Företagsobligationsfond
Rating, %



Företagsobligationsfond	
Totalt antal andelar	9 063 819
Total förmögenhet MSEK	930,6
Likviditet *	1,4%
Duration	0,82
Modifierad duration	0,81%
Modifierad duration krediter	0,81%
Yield	0,73%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	2,96
Avkastning från årets början	0,92%
Avkastning index	-0,21%
Nav-kurs	102,67

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Atrium Ljungberg	7,7
Klarna Bank	6,4
Castellum	6,0
Svensk Fastighetsfinansiering	4,9
Hexagon	4,8
	29,8

AMF FÖRETAGSOBLIGATIONSFOND

Perioden 180829-211231 ^{1),2)}

Marknadsvärde (MSEK) 930,6

Avkastning - portfölj 2,67%

Avkastning - index -1,21%

Skillnad 3,88%

Riskindikator ³⁾ 1

Hållbarhetsbetyg -

Morningstar rating 2

Volatilitet - portfölj ³⁾ 1,7%

Volatilitet - index ³⁾ 0,1%

Aktiv risk ²⁾ 2,1%

Info. Kvot ²⁾ 0,58

Sharpekvot - portfölj ²⁾ 0,77

Jensens alfa ²⁾ 0,9%

Beta ²⁾ 3,61

Förklaringsgrad ²⁾ 1,7%

Konsistens ²⁾ 75,6%

	2021	2020	2019	2018
Marknadsvärde (MSEK)	930,6	700,1	641,8	536,5

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

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

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

	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	Start ⁴⁾
Avkastning - portfölj	0,11%	-0,30%	0,18%	0,92%	3,56%	0,79%
Avkastning - index	-0,04%	-0,08%	-0,11%	-0,21%	-0,91%	-0,36%
<i>Skillnad</i>	0,15%	-0,22%	0,28%	1,14%	4,48%	1,16%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

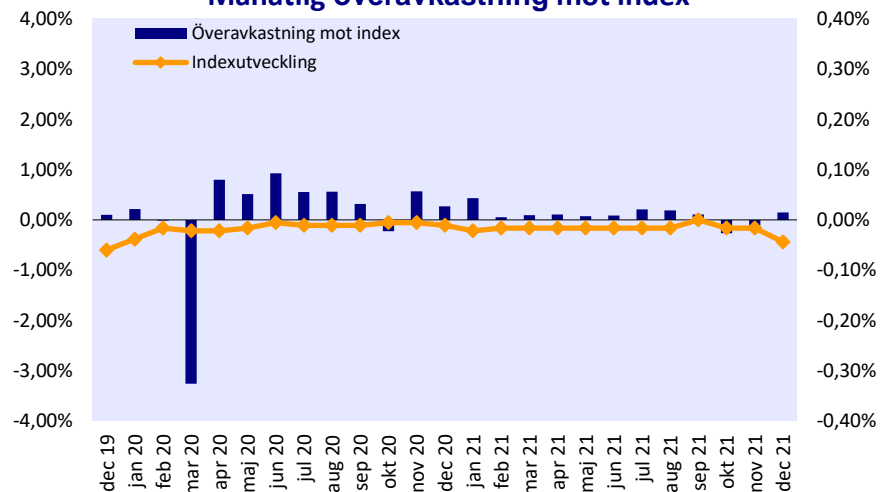
¹⁾ Alla värden beräknas inkl avgifter

²⁾ Från fondens start

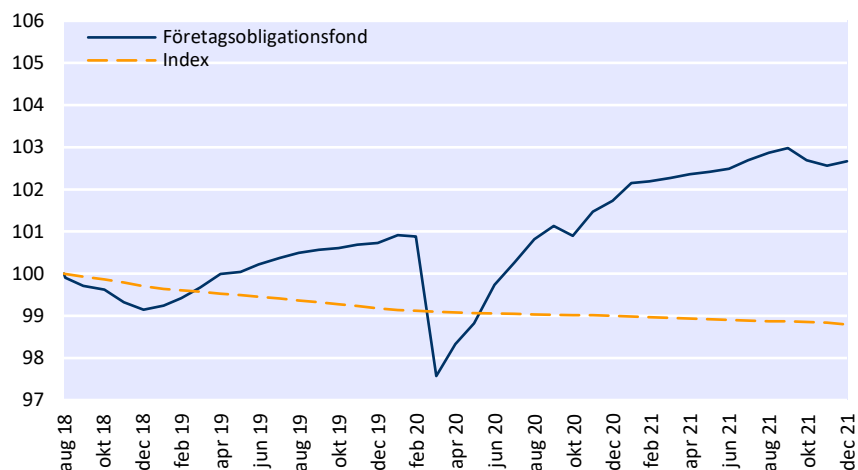
³⁾ Senaste 5 åren, indexdata då fonden ej har funnits

⁴⁾ Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



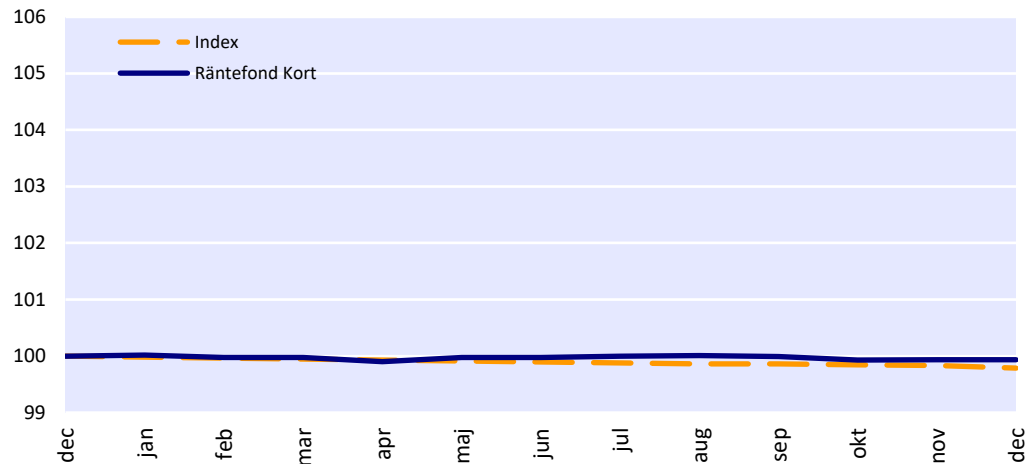
Utveckling fond vs index



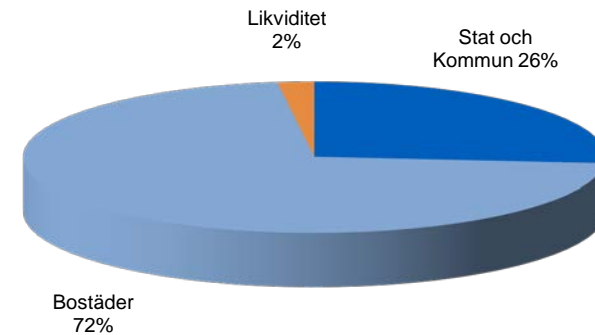
AMF RÄNTEFOND KORT

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
2020-12-31 - 2021-12-31



Placeringar i Råntefond Kort
Emittentfördelning, %



Råntefond Kort	
Totalt antal andelar	57 404 255
Total förmögenhet MSEK	6 399,0
Likviditet *	2,0%
Duration	0,79
Modifierad duration	0,79%
Modifierad duration krediter	0,79%
Yield	-0,04%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	1,94
Avkastning från årets början	-0,06%
Avkastning index	-0,21%
Nav-kurs	111,47

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Kommuninvest	18,7
Skandiabanken	13,9
Nykredit	13,1
Landshypotek	10,2
Realkredit	7,3
Totalt	63,2

AMF RÄNTEFOND KORT

Perioden 161231-211231 (5 år) *
 Marknadsvärde (MSEK) 6 399,0

Avkastning - portfölj -0,89%
 Avkastning - index -2,47%
 Skillnad 1,58%

Riskindikator 1
 Hållbarhetsbetyg -
 Morningstar rating ** -
 Volatilitet - portfölj 0,2%
 Volatilitet - index 0,1%
 Aktiv risk 0,2%
 Info. kvot 1,98
 Sharpekvot - portfölj 1,81
 Jensens alfa 0,3%
 Beta 0,86
 Förklaringsgrad 16,8%
 Konsistens 86,7%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	6 399,0	5 582,1	4 443,6	5 252,2	4 834,0	5 384,6	6 380,6

Avkastning - portfölj	-0,06%	0,27%	-0,30%	-0,46%	-0,34%	0,07%	-0,37%
Avkastning - index	-0,21%	-0,17%	-0,53%	-0,81%	-0,77%	-0,66%	-0,27%
Skillnad	0,15%	0,44%	0,23%	0,34%	0,43%	0,73%	-0,10%

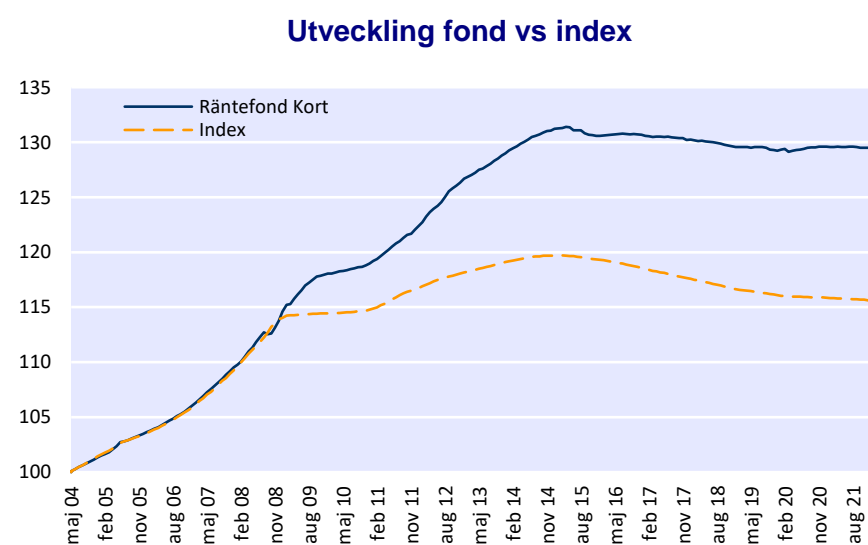
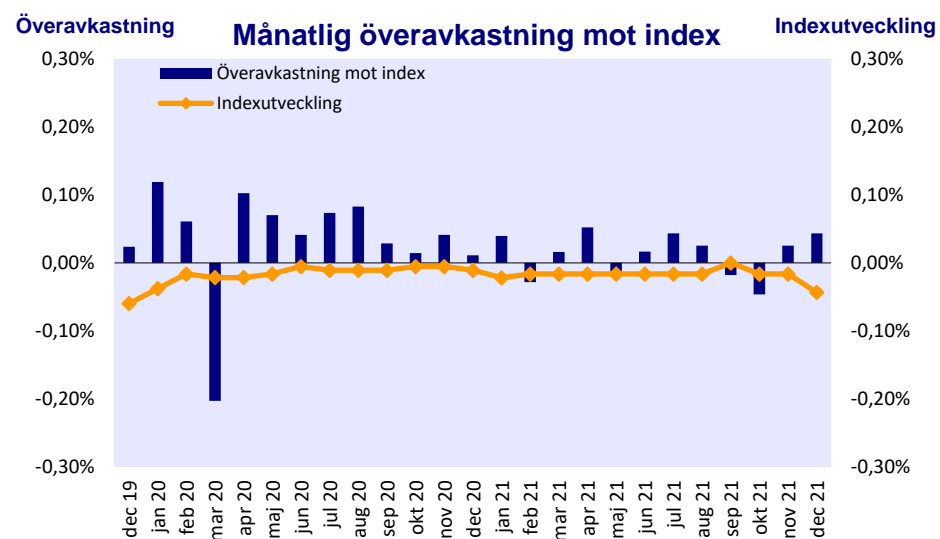
	1 mån	3 mån	6 mån	1 år	3 år	5 år	Start***
Avkastning - portfölj	0,00%	-0,05%	-0,04%	-0,06%	-0,09%	-0,89%	1,48%
Avkastning - index	-0,04%	-0,08%	-0,11%	-0,21%	-0,91%	-2,47%	0,83%
Skillnad	0,04%	0,02%	0,07%	0,15%	0,82%	1,58%	0,65%

Referensindex: Handelsbanken Markets Sweden All Treasury Bills

* Alla värden beräknas inkl avgifter

** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

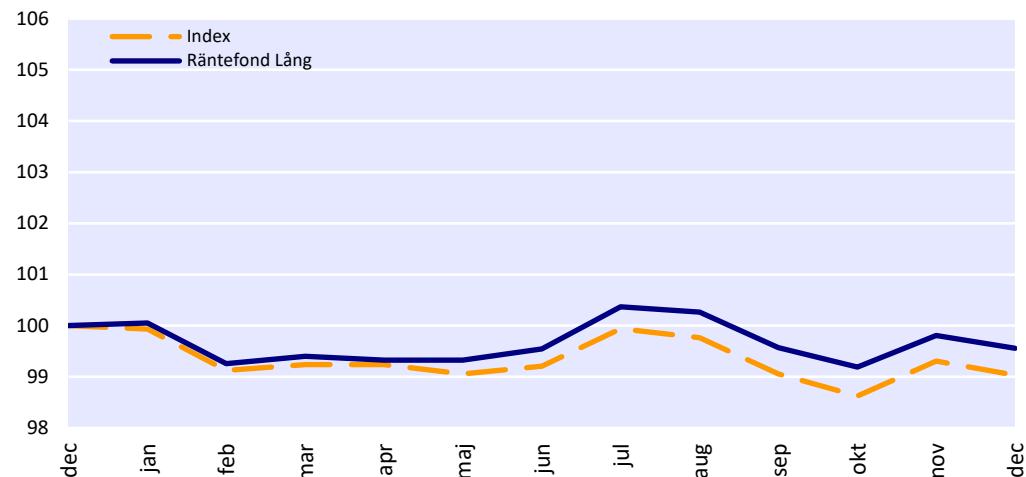
*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start



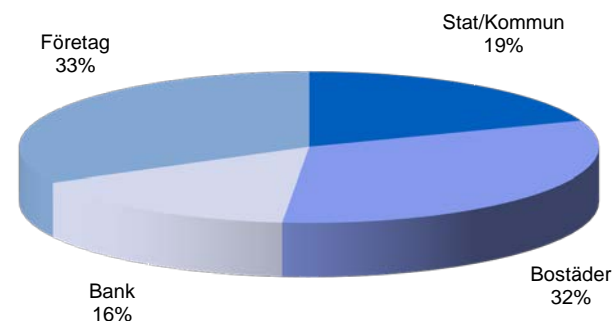
AMF RÄNTEFOND LÅNG

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

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



Placeringar i Räntefond Lång
Emittentfördelning, %



Räntefond Lång

Totalt antal andelar	59 547 187
Total förmögenhet MSEK	9 008,9
Likviditet *	-9,7%
Duration	4,10
Modifierad duration	4,08%
Modifierad duration krediter	2,43%
Yield	0,50%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	4,13
Avkastning från årets början	-0,44%
Avkastning Index	-0,97%
Nav-kurs	151,29

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

Största räntebärande emittenter

Emittent	Portföljandel, %
Stat Sverige	20,2
SBAB	10,8
SEB Bolån	8,9
LF Hypotek	6,7
Klarna Bank	5,9
Totalt	52,5

AMF RÄNTEFOND LÅNG

Perioden 161231-211231 (5 år) *

Marknadsvärde (MSEK) 9 008,9

Avkastning - portfölj 5,3%

Avkastning - index 3,0%

Skillnad 2,2%

Riskindikator 2

Hållbarhetsbetyg 4

Morningstar rating ** 5

Volatilitet - portfölj 1,7%

Volatilitet - index 1,4%

Aktiv risk 0,7%

Info. kvot 0,64

Sharpekvot - portfölj 0,92

Jensens alfa 0,3%

Beta 1,09

Förklaringsgrad 84,3%

Konsistens 83,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	9 008,9	8 859,8	8 621,8	8 077,9	6 970,1	7 328,8	6 501,6

Avkastning - portfölj -0,4% 2,0% 1,7% 1,2% 0,7% 3,3% 0,5%

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

Skillnad 0,5% 0,6% 0,5% 0,1% 0,3% 0,5% 0,0%

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

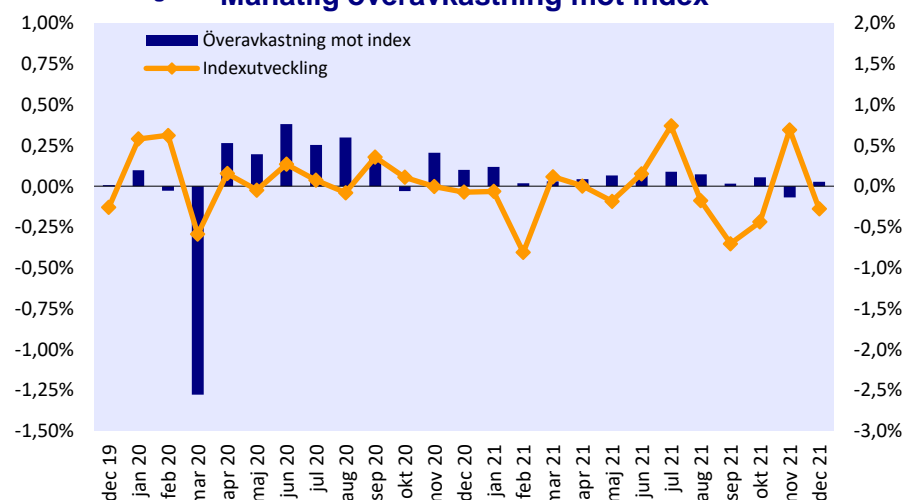
Referensindex: Handelsbanken Markets Combined Sweden All Bonds

* Alla värden beräknas inkl avgifter

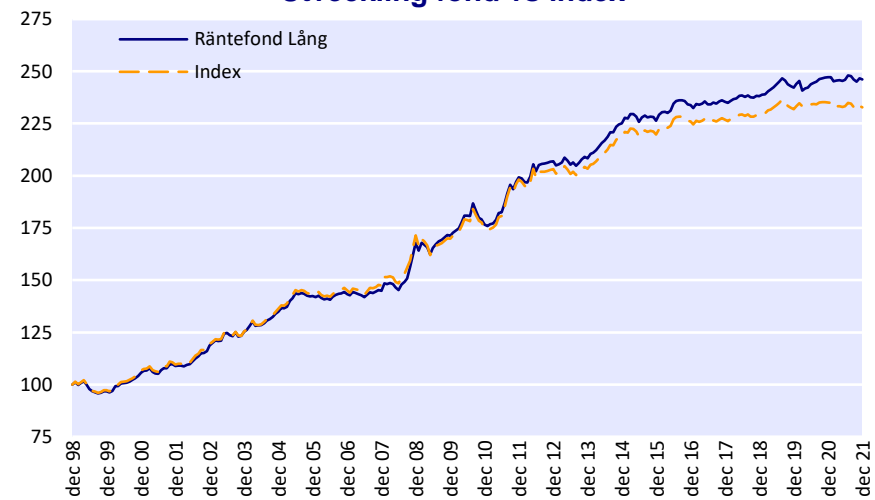
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

***Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

Överavkastning Månatlig överavkastning mot index Indexutveckling



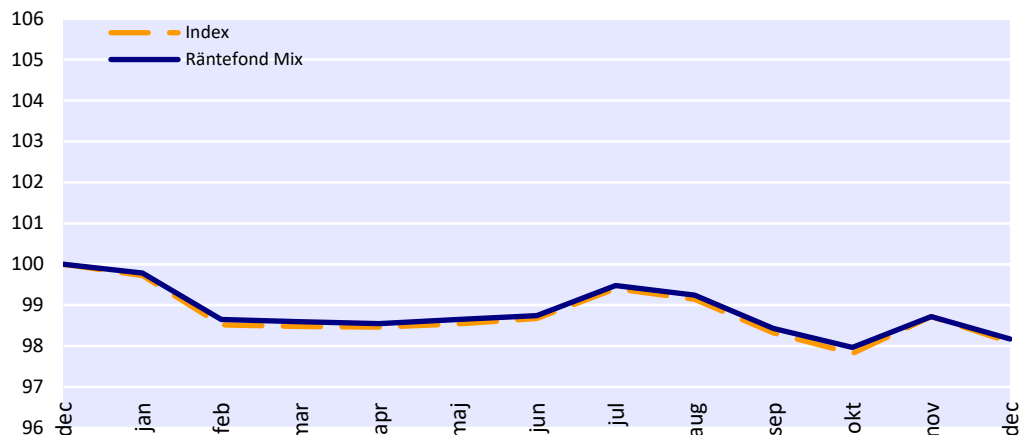
Utveckling fond vs index



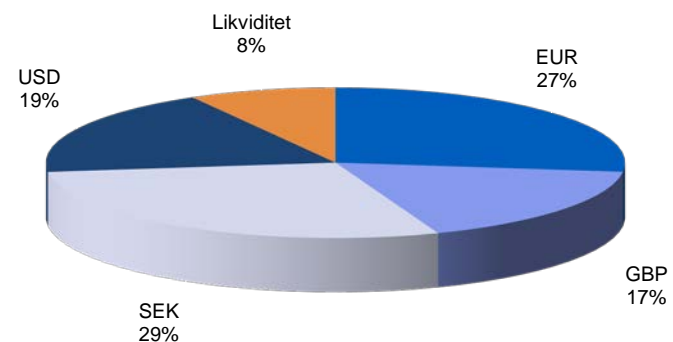
AMF RÄNTEFOND MIX

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

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



Placeringar i Räntefond Mix
Emittentfördelning, %



Räntefond Mix	
Totalt antal andelar	28 605 033
Total förmögenhet MSEK	3 400,0
Likviditet *	8,2%
Duration	4,12
Modifierad duration	4,11%
Modifierad duration krediter	1,16%
Yield	0,28%
Genomsnittlig löptid till förfall, år	4,35
Avkastning från årets början	-1,83%
Avkastning Index	-1,90%
Nav-kurs	118,86

*Justerat för ev. underliggande positioner i derivat

Största räntebärande emittenter	Portföljandel, %
Stat Tyskland	22,6
Stat USA	17,9
Stat Storbritannien	16,9
Stat Sverige	15,6
Stat Italien	3,7
Totalt	76,8

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 161231-211231 (5 år)*

Marknadsvärde (MSEK) 3 400,0

Avkastning - portfölj 1,9%

Avkastning - index 1,2%

Skillnad 0,8%

Riskindikator 2

Hållbarhetsbetyg 4

Morningstar rating** -

Volatilitet - portfölj 1,7%

Volatilitet - index 1,8%

Aktiv risk 0,3%

Info. Kvot 0,53

Sharpekvot - portfölj 0,51

Jensens alfa 0,2%

Beta 0,95

Förklaringsgrad 97,4%

Konsistens 68,3%

	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
Marknadsvärde (MSEK)	3 400,0	3 375,6	1 790,2	1 285,9	990,9	905,7	764,1

Avkastning - portfölj -1,8% 2,7% 1,7% 0,0% -0,6% 2,1% 0,6%

Avkastning - index -1,9% 2,4% 1,4% 0,0% -0,7% 1,9% 0,5%

Skillnad 0,1% 0,3% 0,2% 0,0% 0,2% 0,2% 0,1%

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

Avkastning - portfölj -0,6% -0,3% -0,6% -1,8% 2,5% 1,9% 1,8%

Avkastning - index -0,6% -0,2% -0,6% -1,9% 1,9% 1,2% 1,4%

Skillnad 0,1% 0,0% 0,0% 0,1% 0,6% 0,8% 0,3%

Referensindex: 25% Handelsb. Markets Sweden All Government Bonds 1-10 år, 25% JPM Germany Government index 1-10 år, 25% JPM UK Government index 1-10 år, 25% JPM US Treasury index 1-10 år hedgat till SEK

* Alla värden beräknas inkl avgifter

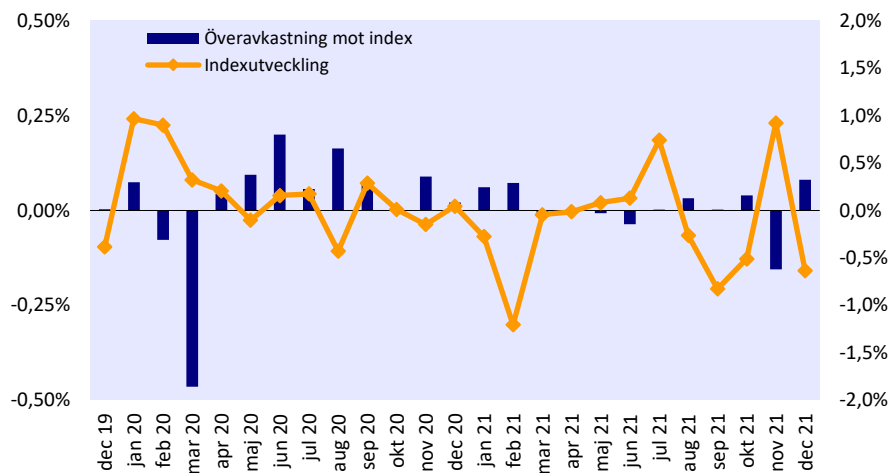
** Morningstars rating, avser föregående månadsskifte

*** Genomsnittlig årsavkastning från fondens start

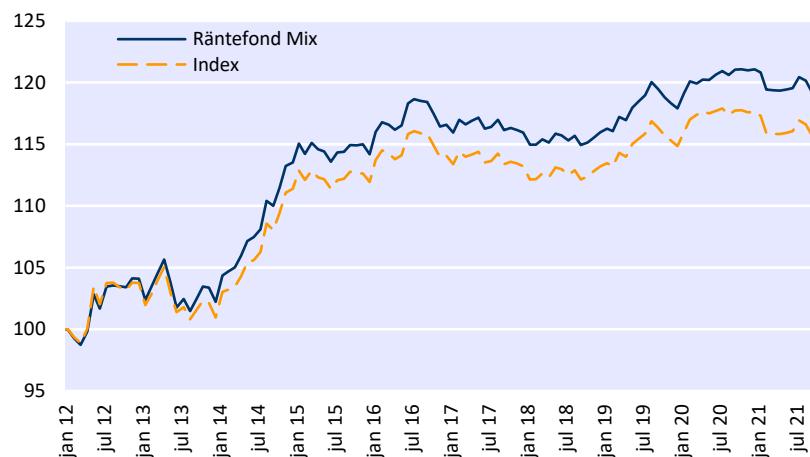
Överavkastning

Månatlig överavkastning mot index

Indexutveckling



Utveckling fond vs index



DEFINITIONER

Avkastning	Avkastningen avser den värdeökning alternativt värdeminskning som uppstått från periodens början till dess slut, inklusive direktavkastning.
Duration	Duration är en räntefonds genomsnittliga återbetalningstid, vägd med kassaströmmarnas nuvärde.
Modifierad Duration	Modifierad duration anger hur känsligt räntefondens värde är för förändringar i räntenivån, det vill säga med hur många procent fondens värde ändras när räntenivån sjunker eller stiger med en procentenhet.
Yield	Förväntad avkastning vid oförändrad räntenivå.
Modifierad Duration Krediter	Modifierad duration på alla innehav exklusive sådana utgivna av stater.
Genomsnittlig löptid till förfall	En sammanvägning av alla innehavs löptid till slutligt förfall.
Volatilitet <i>(total risk)</i>	Volatilitet är ett riskmått, som avser spridning kring förväntad avkastning. Ett stort spridningsmått innebär hög risk och vice versa. Till exempel innebär 10% volatilitet att avkastningen med två tredjedels sannolikhet kommer att hamna inom +/- 10% från den förväntade avkastningen.
Aktiv risk <i>(Tracking Error)</i>	Den aktiva risken mäter storleken på avvikelserna mellan en fonds och dess jämförelseindex avkastning. En hög aktiv risk indikerar att förvaltningen avviker mycket från den övriga marknaden, index. Till exempel innebär 5% aktiv risk att fondens avkastning, två år av tre, kommer att hamna inom ett intervall om 5% från dess jämförelseindex avkastning.
Informationskvot	Informationskvoten ställer en fonds uppnådda avkastning (utöver jämförelseindex) i relation till den aktiva risken. Måttet anger hur mycket extra avkastning som uppnåtts jämfört med hur mycket extra risk som tagits.
Sharpekvot	Ställer avkastning i relation till den totala risken. Anger hur mycket avkastning, nedjusterad med den riskfria räntan, som uppnåtts i relation till hur mycket risk som tagits.
Jensens alfa	Beskriver den uppnådda över- eller underavkastning i förhållande till jämförelseindex med justering av beta, det vill säga med hänsyn till hur stor marknadsrisk som tagits. Om alfa är positivt har fonden överavkastat i förhållande till den marknadsrisk som tagits.
Beta	Beta anger sambandet mellan en fonds avkastning och dess marknads avkastning. Om beta = 1 tenderar fondens avkastning att uppföra sig som marknads avkastning. Beta < 1 innebär att marknads svängningar försvagas och beta > 1 betyder att marknads svängningar förstärks.
Förklaringsgrad	Förklaringsgraden anger hur starkt sambandet är mellan en fond och dess index.
Konsistens	Konsistensen anger hur stor andel av periodens totala antal månader som en fond överträffat jämförelseindex. Måttet kan anta värden mellan 0 och 100 procent, ju högre värde desto bättre konsistens.