

Kapitalforeningen Jyske Portefølje

Specifikation af finansielle instrumenter

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
PB Stabil udl KL						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
Inv-beviser i andre danske UCITS:						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Aktier KL	1.325.446	109,40	145.006.708	1.298.188	92,25	119.760.180
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	441.882	99,40	43.921.215	433.485	84,84	36.776.174
PM Korte Obligationer	874.617	100,35	87.768.078	711.108	96,04	68.297.159
PM Lange Obligationer	1.760.214	100,30	176.551.576	1.632.204	90,19	147.207.499
PM Nye Obligationsmarkeder	278.188	98,85	27.499.468	281.874	77,22	21.766.141
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	276.096	99,87	27.572.548	240.489	94,51	22.729.698
PM Taktisk Allokering KL	862.762	103,53	89.318.299	828.426	91,26	75.605.802
PM Virksomhedsobligationer	383.803	100,02	38.388.936	373.224	83,76	31.259.824
			636.026.828			523.402.477
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	27.758	116,31	24.012.489	25.415	98,24	18.568.457
			24.012.489			18.568.457
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			660.039.317			541.970.933
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	19.820	102,72	15.142.231	17.211	98,60	12.620.032
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	6.207	106,54	4.918.420	3.915	134,24	3.908.329
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	5.808	114,92	4.964.248	3.526	148,68	3.898.633

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	1.412	1.103,31	11.586.798	1.412	1.138,96	11.959.709
			36.611.697			32.386.703
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	193.990	12,24	15.533.602	126.960	12,48	11.275.249
			15.533.602			11.275.249
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			52.145.299			43.661.953
Noterede aktier fra danske selskaber:						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Boligejendomme A/S	0	0,00	0	22.235	201,00	4.469.235
BI Erhvervsnejendomme A/S	142.633	230,62	32.894.022	129.497	234,72	30.395.536
			32.894.022			34.864.771
Noterede aktier fra danske selskaber i alt:			32.894.022			34.864.771
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020813 USD/DKK	-2.322.500	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1020813 USD/DKK	15.285.766	0,81	124.274	0	0,00	0
FXFO1021999 USD/DKK	0	0,00	0	-1.589.500	0,00	0
FXFO1021999 USD/DKK	0	0,00	0	11.131.745	-0,91	-101.649
			124.274			-101.649
Afledte finansielle instrumenter i alt:			124.274			-101.649

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
PB Balanceret udl KL						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
Inv-beviser i andre danske UCITS:						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Aktier KL	8.253.665	109,40	902.969.109	7.032.840	92,25	648.792.149
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	1.141.033	99,40	113.413.888	977.475	84,84	82.927.415
PM Lange Obligationer	4.686.334	100,30	470.044.924	3.505.235	90,19	316.135.042
PM Nye Obligationsmarkeder	651.037	98,85	64.356.375	579.665	77,22	44.761.384
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	622.593	99,87	62.175.748	460.642	94,51	43.537.348
PM Taktisk Allokering KL	3.392.449	103,53	351.206.675	2.850.264	91,26	260.127.634
PM Virksomhedsobligationer	934.569	100,02	93.477.928	748.260	83,76	62.671.414
			2.057.644.646			1.458.952.385
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	36.617	116,31	31.676.104	33.721	98,24	24.636.904
			31.676.104			24.636.904
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			2.089.320.751			1.483.589.290
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	60.047	102,72	45.875.153	47.479	98,60	34.814.160
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	21.698	106,54	17.193.472	12.323	134,24	12.302.003
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	20.303	114,92	17.353.498	11.100	148,68	12.273.063
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	5.326	1.103,31	43.704.878	5.326	1.138,96	45.111.480
			124.127.002			104.500.707
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	521.487	12,24	41.757.677	387.704	12,48	34.431.784
			41.757.677			34.431.784
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			165.884.679			138.932.491

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Noterede aktier fra danske selskaber:						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Boligejendomme A/S	0	0,00	0	34.940	201,00	7.022.940
BI Erhvervsjendomme A/S	222.890	230,62	51.402.892	232.056	234,72	54.468.184
			51.402.892			61.491.124
Noterede aktier fra danske selskaber i alt:			51.402.892			61.491.124
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020814 USD/DKK	-6.243.000	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1020814 USD/DKK	41.088.929	0,81	334.055	0	0,00	0
FXFO1022000 USD/DKK	0	0,00	0	-4.800.000	0,00	0
FXFO1022000 USD/DKK	0	0,00	0	33.615.840	-0,91	-306.960
			334.055			-306.960
Afledte finansielle instrumenter i alt:			334.055			-306.960

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
PB Dynamisk udl KL						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
Inv-beviser i andre danske UCITS:						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Aktier KL	7.709.376	109,40	843.422.695	7.759.168	92,25	715.797.215
PM Lange Obligationer	634.970	100,30	63.688.253	397.987	90,19	35.894.209
PM Nye Obligationsmarkeder	371.873	98,85	36.760.427	365.243	77,22	28.203.845
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	373.887	99,87	37.338.524	304.513	94,51	28.780.894
PM Taktisk Allokering KL	2.482.860	103,53	257.040.564	2.419.625	91,26	220.825.624
PM Virksomhedsobligationer	637.306	100,02	63.744.939	563.492	83,76	47.195.949
			1.301.995.403			1.076.697.735
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	19.078	116,31	16.503.720	24.317	98,24	17.766.247
			16.503.720			17.766.247
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			1.318.499.123			1.094.463.982
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	37.080	102,72	28.328.654	38.989	98,60	28.588.835
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	14.825	106,54	11.747.314	10.084	134,24	10.066.818
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	13.994	114,92	11.961.033	9.083	148,68	10.042.904
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	3.730	1.103,31	30.608.186	4.353	1.138,96	36.870.123
			82.645.187			85.568.680
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	290.095	12,24	23.229.125	291.502	12,48	25.888.123
			23.229.125			25.888.123
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			105.874.312			111.456.803
Noterede aktier fra danske selskaber:						

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Instrumentets valuta: DKK						
BI Erhvervsejendomme A/S	30.897	230,62	7.125.466	44.210	234,72	10.376.971
			7.125.466			10.376.971
Noterede aktier fra danske selskaber i alt:			7.125.466			10.376.971
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020815 USD/DKK	-3.473.000	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1020815 USD/DKK	22.857.897	0,81	185.836	0	0,00	0
FXFO1022001 USD/DKK	0	0,00	0	-3.473.000	0,00	0
FXFO1022001 USD/DKK	0	0,00	0	24.322.461	-0,91	-222.099
FXFO1022036 USD/DKK	0	0,00	0	-167.000	0,00	0
FXFO1022036 USD/DKK	0	0,00	0	1.166.764	-1,15	-13.470
			185.836			-235.569
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar22	450	130,70	384.665	0	0,00	0
S&P500 EMINI FUT Sep22	0	0,00	0	450	49,50	158.450
			384.665			158.450
Afledte finansielle instrumenter i alt:			570.501			-77.119

31-12-2021

30-06-2022

Papirnavn	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
-----------	------------	----------	-----------	------------	----------	-----------

PB Vækst udl KL

Afdelingens funktionelle valuta: DKK

Inv-beviser i andre danske UCITS:

Instrumentets valuta: DKK

PM Aktier KL	6.007.291	109,40	657.210.851	5.922.454	92,25	546.357.042
PM Lange Obligationer	156.444	100,30	15.691.521	68.922	90,19	6.216.034
PM Nye Obligationsmarkeder	216.618	98,85	21.413.144	216.754	77,22	16.737.614
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	216.738	99,87	21.644.714	184.737	94,51	17.460.325
			715.960.230			586.771.015

Instrumentets valuta: EUR

All Corporate Credit KL	11.674	116,31	10.098.775	11.674	98,24	8.529.143
			10.098.775			8.529.143

Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:**726.059.005****595.300.157****Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:**

Instrumentets valuta: EUR

Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	13.322	106,54	10.556.339	8.468	134,24	8.453.572
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	12.562	114,92	10.736.946	7.628	148,68	8.433.983
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	2.893	1.103,31	23.739.807	3.276	1.138,96	27.746.017
Xtrackers MSCI AC World ESG Screened UCITS ETF	44.287	31,88	10.499.235	43.486	27,13	8.773.577
Xtrackers MSCI World UCITS ETF	50.640	86,66	32.640.260	49.017	74,22	27.056.308
			88.172.587			80.463.456

Instrumentets valuta: USD

GAM FCM ILS Return Fund	73.107	12,24	5.853.988	73.107	12,48	6.492.593
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	67.366	35,66	15.709.254	0	0,00	0
iShares MSCI EM IMI ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	317.744	5,62	12.702.460
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF	161.158	8,33	8.775.717	150.305	6,55	7.006.285
			30.338.959			26.201.339

Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:**118.511.545****106.664.794**

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020816 USD/DKK	-875.230	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1020816 USD/DKK	5.760.414	0,81	46.832	0	0,00	0
FXFO1022002 USD/DKK	0	0,00	0	-875.230	0,00	0
FXFO1022002 USD/DKK	0	0,00	0	6.129.498	-0,91	-55.971
FXFO1022037 USD/DKK	0	0,00	0	-37.000	0,00	0
FXFO1022037 USD/DKK	0	0,00	0	258.520	-1,15	-2.969
			46.832			-58.941
Instrumentets valuta: EUR						
EURO STOXX 50 Mar22	130	136,00	131.496	0	0,00	0
EURO STOXX 50 Sep22	0	0,00	0	380	-12,08	-34.125
			131.496			-34.125
Instrumentets valuta: JPY						
NIKKEI 225 (OSE) Sep22	0	0,00	0	3.000	-1.001,11	-157.254
NIKKEI 225 (SGX) Mar22	2.000	975,00	110.751	0	0,00	0
			110.751			-157.254
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar22	900	130,70	769.330	0	0,00	0
S&P500 EMINI FUT Sep22	0	0,00	0	1.400	49,43	492.224
			769.330			492.224
Afledte finansielle instrumenter i alt:			1.058.409			241.904

Papirnavn	31-12-2021			30-06-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Alternativer KL						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
Inv-beviser i andre danske UCITS:						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Lange Obligationer	0	0,00	0	38.705	90,19	3.490.781
			0			3.490.781
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			0			3.490.781
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	0	0,00	0	51.198	98,60	37.541.131
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	0	0,00	0	9.012	134,24	8.996.645
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	0	0,00	0	8.002	148,68	8.847.662
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	0	0,00	0	8.449	1.138,96	71.561.068
			0			126.946.506
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	0	0,00	0	199.406	12,48	17.709.140
			0			17.709.140
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			0			144.655.646
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1021997 USD/DKK	0	0,00	0	-2.459.000	0,00	0
FXFO1021997 USD/DKK	0	0,00	0	17.221.115	-0,91	-157.253
			0			-157.253
Afledte finansielle instrumenter i alt:			0			-157.253