

Kapitalforeningen Jyske Portefølje

Specifikation af finansielle instrumenter

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	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						
BankInvest Globale Aktier Akk.A Inc KL	0	0,00	0	60.319	102,32	6.171.840
BankInvest Danske Aktier KL	0	0,00	0	183.407	123,50	22.650.765
Danske Obligationer KL	0	0,00	0	2.152.730	101,32	218.112.020
Jyske Invest Aktier Lav Volatilitet KL	0	0,00	0	185.139	113,02	20.923.521
Jyske Invest Bæredygtige Aktier KL	0	0,00	0	425.989	101,53	43.249.343
Jyske Invest Højt Ratede Virksomhedsobligationer K	0	0,00	0	225.082	109,94	24.745.875
Jyske Invest Lange Obligationer	0	0,00	0	2.171.659	100,99	219.315.842
Jyske Invest Nye Aktiemarkeder KL	0	0,00	0	51.886	292,55	15.179.218
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder	0	0,00	0	263.187	122,39	32.210.641
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder Valuta	0	0,00	0	298.052	109,70	32.695.500
Jyske Invest Virksomhedsobligationer	0	0,00	0	412.527	100,97	41.653.057
Managed Vol Aktier KL	0	0,00	0	80.903	108,46	8.774.335
PM Aktier KL	1.325.446	109,40	145.006.708	0	0,00	0
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	441.882	99,40	43.921.215	0	0,00	0
PM Korte Obligationer	874.617	100,35	87.768.078	0	0,00	0
PM Lange Obligationer	1.760.214	100,30	176.551.576	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder	278.188	98,85	27.499.468	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	276.096	99,87	27.572.548	0	0,00	0
PM Taktisk Allokering KL	862.762	103,53	89.318.299	0	0,00	0

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
PM Virksomhedsobligationer	383.803	100,02	38.388.936	0	0,00	0
			636.026.828			685.681.957
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	27.758	116,31	24.012.489	28.266	112,67	23.705.643
			24.012.489			23.705.643
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			660.039.317			709.387.600
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	19.820	102,72	15.142.231	20.687	97,64	15.034.899
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	6.207	106,54	4.918.420	8.287	106,94	6.596.488
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	5.808	114,92	4.964.248	5.649	108,21	4.550.029
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	1.412	1.103,31	11.586.798	0	0,00	0
Xtrackers MSCI World UCITS ETF	0	0,00	0	21.487	65,33	10.449.374
Xtrackers MSCI World Communication Services UCITS ETF	0	0,00	0	65.427	14,55	7.084.930
Xtrackers MSCI World Financials UCITS ETF	0	0,00	0	69.423	16,27	8.408.520
Xtrackers MSCI World Industrials UCITS ETF	0	0,00	0	26.256	35,51	6.939.920
Xtrackers MSCI World Information Technology UCITS ETF	0	0,00	0	36.703	42,57	11.630.020
Xtrackers MSCI World Materials UCITS ETF	0	0,00	0	18.781	40,01	5.593.228
			36.611.697			76.287.407
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	193.990	12,24	15.533.602	193.990	11,63	13.723.591
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	0	0,00	0	77.919	35,89	17.012.586
iShares Edge MSCI World Value Factor UCITS ETF	0	0,00	0	16.227	31,47	3.106.623
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	249.688	6,80	10.324.486
iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF	0	0,00	0	17.662	58,94	6.332.913
iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF	0	0,00	0	10.616	47,21	3.048.937
			15.533.602			53.549.136
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			52.145.299			129.836.542

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Noterede aktier fra danske selskaber:						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Erhvervsjendomme A/S	142.633	230,62	32.894.022	93.813	218,36	20.485.007
			32.894.022			20.485.007
Noterede aktier fra danske selskaber i alt:			32.894.022			20.485.007
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1018949 USD/DKK	0	0,00	0	-2.215.500	0,00	0
FXFO1018949 USD/DKK	0	0,00	0	13.538.034	0,61	82.333
FXFO1019047 USD/DKK	0	0,00	0	-36.000	0,00	0
FXFO1019047 USD/DKK	0	0,00	0	218.676	0,01	30
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
			124.274			82.363
Instrumentets valuta: EUR						
DAX INDEX FUTURE Mar21	0	0,00	0	25	226,00	42.056
			0			42.056
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar21	0	0,00	0	150	61,00	55.664
			0			55.664
Afledte finansielle instrumenter i alt:			124.274			180.083

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	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						
BankInvest Globale Aktier Akk.A Inc KL	0	0,00	0	252.681	102,32	25.854.320
BankInvest Danske Aktier KL	0	0,00	0	814.188	123,50	100.552.218
Jyske Invest Aktier Lav Volatilitet KL	0	0,00	0	809.762	113,02	91.515.414
Jyske Invest Bæredygtige Aktier KL	0	0,00	0	1.822.042	101,53	184.986.276
Jyske Invest Højt Ratede Virksomhedsobligationer K	0	0,00	0	438.281	109,94	48.185.314
Jyske Invest Lange Obligationer	0	0,00	0	6.212.740	100,99	627.424.613
Jyske Invest Nye Aktiemarkeder KL	0	0,00	0	227.864	292,55	66.661.476
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder	0	0,00	0	434.117	122,39	53.130.234
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder Valuta	0	0,00	0	462.943	109,70	50.783.597
Jyske Invest Virksomhedsobligationer	0	0,00	0	685.510	100,97	69.216.287
Managed Vol Aktier KL	0	0,00	0	365.627	108,46	39.654.076
PM Aktier KL	8.253.665	109,40	902.969.109	0	0,00	0
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	1.141.033	99,40	113.413.888	0	0,00	0
PM Lange Obligationer	4.686.334	100,30	470.044.924	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder	651.037	98,85	64.356.375	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	622.593	99,87	62.175.748	0	0,00	0
PM Taktisk Allokering KL	3.392.449	103,53	351.206.675	0	0,00	0
PM Virksomhedsobligationer	934.569	100,02	93.477.928	0	0,00	0
			2.057.644.646			1.357.963.826
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	36.617	116,31	31.676.104	28.367	112,67	23.790.348
			31.676.104			23.790.348
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			2.089.320.751			1.381.754.174
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	60.047	102,72	45.875.153	55.198	97,64	40.116.806
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	21.698	106,54	17.193.472	22.425	106,94	17.850.396
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	20.303	114,92	17.353.498	14.775	108,21	11.900.635
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	5.326	1.103,31	43.704.878	0	0,00	0
Xtrackers MSCI AC World ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	152.100	24,63	27.879.224
Xtrackers MSCI World UCITS ETF	0	0,00	0	23.983	65,33	11.663.207
Xtrackers MSCI World Communication Services UCITS ETF	0	0,00	0	271.677	14,55	29.419.237
Xtrackers MSCI World Financials UCITS ETF	0	0,00	0	292.374	16,27	35.412.364
Xtrackers MSCI World Industrials UCITS ETF	0	0,00	0	109.310	35,51	28.892.545
Xtrackers MSCI World Information Technology UCITS ETF	0	0,00	0	153.766	42,57	48.723.581
Xtrackers MSCI World Materials UCITS ETF	0	0,00	0	78.019	40,01	23.235.080
			124.127.002			275.093.075
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	521.487	12,24	41.757.677	521.487	11,63	36.891.975
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	0	0,00	0	234.940	35,89	51.296.051
iShares Edge MSCI World Value Factor UCITS ETF	0	0,00	0	67.981	31,47	13.014.809
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	904.757	6,80	37.411.294
iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF	0	0,00	0	73.515	58,94	26.359.648
iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF	0	0,00	0	44.474	47,21	12.773.023
			41.757.677			177.746.801
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			165.884.679			452.839.876
Noterede aktier fra danske selskaber:						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Erhvervsjendomme A/S	222.890	230,62	51.402.892	118.158	218,36	25.800.981
			51.402.892			25.800.981
Noterede aktier fra danske selskaber i alt:			51.402.892			25.800.981
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
FXFO1018950 USD/DKK	0	0,00	0	-5.987.500	0,00	0
FXFO1018950 USD/DKK	0	0,00	0	36.587.218	0,61	222.508
FXFO1019048 USD/DKK	0	0,00	0	-97.000	0,00	0
FXFO1019048 USD/DKK	0	0,00	0	589.080	-0,01	-48
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
			334.055			222.460
Afledte finansielle instrumenter i alt:			334.055			222.460

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	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						
BankInvest Globale Aktier Akk.A Inc KL	0	0,00	0	182.915	102,32	18.715.863
BankInvest Danske Aktier KL	0	0,00	0	537.714	123,50	66.407.679
Jyske Invest Aktier Lav Volatilitet KL	0	0,00	0	572.020	113,02	64.646.955
Jyske Invest Bæredygtige Aktier KL	0	0,00	0	1.305.177	101,53	132.510.575
Jyske Invest Lange Obligationer	0	0,00	0	1.391.125	100,99	140.489.714
Jyske Invest Nye Aktiemarkeder KL	0	0,00	0	164.271	292,55	48.057.382
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder	0	0,00	0	173.027	122,39	21.176.238
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder Valuta	0	0,00	0	192.378	109,70	21.103.347
Jyske Invest Virksomhedsobligationer	0	0,00	0	268.524	100,97	27.113.003
Managed Vol Aktier KL	0	0,00	0	258.837	108,46	28.072.167
PM Aktier KL	7.709.376	109,40	843.422.695	0	0,00	0
PM Lange Obligationer	634.970	100,30	63.688.253	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder	371.873	98,85	36.760.427	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	373.887	99,87	37.338.524	0	0,00	0
PM Taktisk Allokering KL	2.482.860	103,53	257.040.564	0	0,00	0
PM Virksomhedsobligationer	637.306	100,02	63.744.939	0	0,00	0
			1.301.995.403			568.292.922
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	19.078	116,31	16.503.720	16.818	112,67	14.104.631
			16.503.720			14.104.631
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			1.318.499.123			582.397.553
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	37.080	102,72	28.328.654	28.750	97,64	20.894.927
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	14.825	106,54	11.747.314	17.640	106,94	14.041.516

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	13.994	114,92	11.961.033	10.145	108,21	8.171.366
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	3.730	1.103,31	30.608.186	0	0,00	0
Xtrackers MSCI AC World ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	48.285	24,63	8.850.417
Xtrackers MSCI World UCITS ETF	0	0,00	0	19.205	65,33	9.339.611
Xtrackers MSCI World Communication Services UCITS ETF	0	0,00	0	186.066	14,55	20.148.631
Xtrackers MSCI World Financials UCITS ETF	0	0,00	0	213.237	16,27	25.827.284
Xtrackers MSCI World Industrials UCITS ETF	0	0,00	0	81.606	35,51	21.569.893
Xtrackers MSCI World Information Technology UCITS ETF	0	0,00	0	108.712	42,57	34.447.394
Xtrackers MSCI World Materials UCITS ETF	0	0,00	0	50.404	40,01	15.010.971
			82.645.187			178.302.010
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	290.095	12,24	23.229.125	229.906	11,63	16.264.425
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	0	0,00	0	165.490	35,89	36.132.560
iShares Edge MSCI World Value Factor UCITS ETF	0	0,00	0	47.547	31,47	9.102.766
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	610.132	6,80	25.228.683
iShares Edge MSCI World Momentum Factor UCITS ETF	0	0,00	0	52.593	58,94	18.857.824
iShares Edge MSCI World Quality Factor UCITS ETF	0	0,00	0	32.252	47,21	9.262.840
			23.229.125			114.849.098
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			105.874.312			293.151.108
Noterede aktier fra danske selskaber:						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Erhvervsejendomme A/S	30.897	230,62	7.125.466	26.831	218,36	5.858.817
			7.125.466			5.858.817
Noterede aktier fra danske selskaber i alt:			7.125.466			5.858.817
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1018953 USD/DKK	0	0,00	0	-2.656.500	0,00	0
FXFO1018953 USD/DKK	0	0,00	0	16.232.809	0,61	98.721

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
FXFO1019030 USD/DKK	0	0,00	0	-439.000	0,00	0
FXFO1019030 USD/DKK	0	0,00	0	2.668.063	0,07	1.807
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
			185.836			100.528
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar22	450	130,70	384.665	0	0,00	0
			384.665			0
Afledte finansielle instrumenter i alt:			570.501			100.528

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	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						
BankInvest Globale Aktier Akk.A Inc KL	0	0,00	0	153.471	102,32	15.703.153
BankInvest Danske Aktier KL	0	0,00	0	452.307	123,50	55.859.915
Jyske Invest Aktier Lav Volatilitet KL	0	0,00	0	481.533	113,02	54.420.548
Jyske Invest Bæredygtige Aktier KL	0	0,00	0	1.092.391	101,53	110.907.072
Jyske Invest Lange Obligationer	0	0,00	0	85.207	100,99	8.605.055
Jyske Invest Nye Aktiemarkeder KL	0	0,00	0	136.929	292,55	40.058.497
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder	0	0,00	0	108.244	122,39	13.247.648
Jyske Invest Nye Obligationsmarkeder Valuta	0	0,00	0	121.885	109,70	13.370.455
Jyske Invest Virksomhedsobligationer	0	0,00	0	88.319	100,97	8.917.614
Managed Vol Aktier KL	0	0,00	0	214.912	108,46	23.308.281
PM Aktier KL	6.007.291	109,40	657.210.851	0	0,00	0
PM Lange Obligationer	156.444	100,30	15.691.521	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder	216.618	98,85	21.413.144	0	0,00	0
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	216.738	99,87	21.644.714	0	0,00	0
			715.960.230			344.398.237
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	11.674	116,31	10.098.775	16.775	112,67	14.068.569
			10.098.775			14.068.569
Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:			726.059.005			358.466.805
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:						
Instrumentets valuta: EUR						
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	13.322	106,54	10.556.339	9.545	106,94	7.597.861
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	12.562	114,92	10.736.946	9.044	108,21	7.284.445
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	2.893	1.103,31	23.739.807	0	0,00	0
Xtrackers MSCI AC World ESG Screened UCITS ETF	44.287	31,88	10.499.235	46.671	24,63	8.554.578

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Xtrackers MSCI World UCITS ETF	50.640	86,66	32.640.260	43.821	65,33	21.310.653
Xtrackers MSCI World Communication Services UCITS ETF	0	0,00	0	156.659	14,55	16.964.219
Xtrackers MSCI World Financials UCITS ETF	0	0,00	0	172.527	16,27	20.896.485
Xtrackers MSCI World Industrials UCITS ETF	0	0,00	0	67.474	35,51	17.834.559
Xtrackers MSCI World Information Technology UCITS ETF	0	0,00	0	91.039	42,57	28.847.379
Xtrackers MSCI World Materials UCITS ETF	0	0,00	0	44.570	40,01	13.273.530
			88.172.587			142.563.709
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	73.107	12,24	5.853.988	73.107	11,63	5.171.867
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	67.366	35,66	15.709.254	106.724	35,89	23.301.778
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF	161.158	8,33	8.775.717	553.525	6,80	22.888.009
			30.338.959			51.361.655
Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:			118.511.545			193.925.364
Afledte finansielle instrumenter:						
Instrumentets valuta:						
FXFO1018954 USD/DKK	0	0,00	0	-762.230	0,00	0
FXFO1018954 USD/DKK	0	0,00	0	4.657.683	0,61	28.326
FXFO1018957 USD/DKK	0	0,00	0	-85.000	0,00	0
FXFO1018957 USD/DKK	0	0,00	0	518.914	0,51	2.672
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
			46.832			30.998
Instrumentets valuta: EUR						
EURO STOXX 50 Mar22	130	136,00	131.496	0	0,00	0
			131.496			0
Instrumentets valuta: JPY						
NIKKEI 225 (SGX) Mar22	2.000	975,00	110.751	0	0,00	0
			110.751			0

Papirnavn	31-12-2021			31-12-2020		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar22	900	130,70	769.330	0	0,00	0
			769.330			0
Afledte finansielle instrumenter i alt:			1.058.409			30.998