

# Kapitalforeningen Jyske Portefølje

## Specifikation af finansielle instrumenter

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
<b>PB Stabil udl KL</b>						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Aktier KL	1.020.497	105,57	107.738.461	1.156.110	92,75	107.234.636
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	382.955	89,38	34.228.250	417.955	82,34	34.414.665
PM Korte Obligationer	686.775	98,38	67.563.414	679.930	94,95	64.558.470
PM Lange Obligationer	1.521.480	92,50	140.731.423	1.512.983	87,23	131.981.592
PM Nye Obligationsmarkeder	252.181	85,01	21.437.503	276.277	78,86	21.786.099
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	207.797	107,22	22.279.600	224.561	96,72	21.720.640
PM Taktisk Allokering KL	706.076	97,49	68.835.067	729.186	92,74	67.622.595
PM Virksomhedsobligationer	314.050	93,76	29.445.140	350.327	86,01	30.130.364
			<b>492.258.856</b>			<b>479.449.062</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	25.415	113,96	21.590.171	25.415	101,47	19.177.759
			<b>21.590.171</b>			<b>19.177.759</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>513.849.027</b>			<b>498.626.821</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	8.692	95,88	6.212.552	12.236	95,71	8.708.869
AQR UCITS Funds - AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund	5.804	102,63	4.440.420	6.292	99,29	4.645.786
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	0	0,00	0	2.708	132,60	2.670.282

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	1.826	149,47	2.034.591	2.444	153,23	2.784.902
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	159	915,97	1.085.677	207	947,50	1.458.527
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	870	1.183,76	7.677.242	916	1.149,07	7.827.209
Private Equity And Infrastructure PLC	1.959	104,82	1.530.738	0	0,00	0
Virtus GF Alphasimplex Managed Futures Fund	2.135	122,40	1.948.057	0	0,00	0
			<b>24.929.277</b>			<b>28.095.574</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	58.420	14,04	5.534.834	96.826	11,73	7.912.451
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	149	937,77	942.930	202	951,32	1.338.994
			<b>6.477.764</b>			<b>9.251.445</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>31.407.040</b>			<b>37.347.019</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Boligejendomme A/S	22.235	161,51	3.591.175	22.235	178,80	3.975.618
BI Erhvervsjendomme A/S	65.240	210,64	13.742.154	121.392	220,69	26.790.000
			<b>17.333.328</b>			<b>30.765.618</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber i alt:</b>			<b>17.333.328</b>			<b>30.765.618</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1022878 USD/DKK	0	0,00	0	-1.120.800	0,00	0
FXFO1022878 USD/DKK	0	0,00	0	7.782.835	0,29	22.948
FXFO1024213 USD/DKK	-1.155.000	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1024213 USD/DKK	7.840.429	1,00	78.506	0	0,00	0
			<b>78.506</b>			<b>22.948</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>78.506</b>			<b>22.948</b>

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
<b>PB Balanceret udl KL</b>						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Aktier KL	5.659.727	105,57	597.522.848	6.758.734	92,75	626.904.345
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	869.606	89,38	77.724.776	983.955	82,34	81.019.445
PM Lange Obligationer	3.604.363	92,50	333.390.602	3.512.434	87,23	306.399.101
PM Nye Obligationsmarkeder	484.240	85,01	41.164.468	563.901	78,86	44.466.977
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	387.606	107,22	41.558.379	443.601	96,72	42.907.262
PM Taktisk Allokering KL	2.395.131	97,49	233.500.363	2.658.477	92,74	246.539.447
PM Virksomhedsobligationer	613.787	93,76	57.548.301	743.145	86,01	63.915.226
			<b>1.382.409.736</b>			<b>1.412.151.804</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	33.721	113,96	28.646.160	33.721	101,47	25.445.336
			<b>28.646.160</b>			<b>25.445.336</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>1.411.055.896</b>			<b>1.437.597.141</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	25.240	95,88	18.040.130	37.943	95,71	27.005.607
AQR UCITS Funds - AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund	18.699	102,63	14.305.894	17.251	99,29	12.737.516
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	0	0,00	0	10.123	132,60	9.982.003
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	7.549	149,47	8.411.351	9.823	153,23	11.193.165
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	465	915,97	3.175.094	561	947,50	3.952.819
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	3.366	1.183,76	29.702.983	3.978	1.149,07	33.991.961
Private Equity And Infrastructure PLC	12.513	104,82	9.777.502	0	0,00	0
Virtus GF Alphasimplex Managed Futures Fund	7.623	122,40	6.955.520	0	0,00	0
			<b>90.368.475</b>			<b>98.863.071</b>
Instrumentets valuta: USD						

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
GAM FCM ILS Return Fund	158.476	14,04	15.014.351	281.217	11,73	22.980.561
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	500	937,77	3.164.194	545	951,32	3.612.632
			<b>18.178.545</b>			<b>26.593.193</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>108.547.020</b>			<b>125.456.264</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Boligejendomme A/S	34.940	161,51	5.643.159	34.940	178,80	6.247.272
BI Erhvervsnejendomme A/S	104.568	210,64	22.026.204	232.056	220,69	51.212.439
			<b>27.669.363</b>			<b>57.459.711</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber i alt:</b>			<b>27.669.363</b>			<b>57.459.711</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1022879 USD/DKK	0	0,00	0	-3.255.800	0,00	0
FXFO1022879 USD/DKK	0	0,00	0	22.608.275	0,29	66.662
FXFO1024214 USD/DKK	-3.182.000	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1024214 USD/DKK	21.600.212	1,00	216.282	0	0,00	0
			<b>216.282</b>			<b>66.662</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>216.282</b>			<b>66.662</b>

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
<b>PB Dynamisk udl KL</b>						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Aktier KL	7.610.085	105,57	803.430.919	7.720.259	92,75	716.090.307
PM Lange Obligationer	690.075	92,50	63.829.453	472.503	87,23	41.217.712
PM Nye Obligationsmarkeder	403.016	85,01	34.259.745	388.267	78,86	30.617.183
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	326.161	107,22	34.970.363	324.118	96,72	31.350.281
PM Taktisk Allokering KL	2.413.492	97,49	235.290.370	2.383.812	92,74	221.067.812
PM Virksomhedsobligationer	570.858	93,76	53.523.304	577.445	86,01	49.663.966
			<b>1.225.304.153</b>			<b>1.090.007.261</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	24.317	113,96	20.657.415	24.317	101,47	18.349.226
			<b>20.657.415</b>			<b>18.349.226</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>1.245.961.568</b>			<b>1.108.356.487</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	24.676	95,88	17.637.015	27.815	95,71	19.797.089
AQR UCITS Funds - AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund	17.624	102,63	13.483.452	12.646	99,29	9.337.350
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	0	0,00	0	9.840	132,60	9.702.945
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	8.179	149,47	9.113.318	8.239	153,23	9.388.220
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	409	915,97	2.792.717	409	947,50	2.881.823
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	3.358	1.183,76	29.632.388	3.948	1.149,07	33.735.611
Private Equity And Infrastructure PLC	14.224	104,82	11.114.456	0	0,00	0
Virtus GF Alphasimplex Managed Futures Fund	9.652	122,40	8.806.859	0	0,00	0
			<b>92.580.205</b>			<b>84.843.039</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	136.881	14,04	12.968.381	205.230	11,73	16.771.024

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	398	937,77	2.518.698	398	951,32	2.638.216
			<b>15.487.079</b>			<b>19.409.240</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>108.067.284</b>			<b>104.252.279</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Erhvervsjendomme A/S	29.901	210,64	6.298.347	52.315	220,69	11.545.397
			<b>6.298.347</b>			<b>11.545.397</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber i alt:</b>			<b>6.298.347</b>			<b>11.545.397</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1022880 USD/DKK	0	0,00	0	-2.375.600	0,00	0
FXFO1022880 USD/DKK	0	0,00	0	16.496.166	0,29	48.640
FXFO1024215 USD/DKK	-2.460.000	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1024215 USD/DKK	16.699.095	1,00	167.207	0	0,00	0
			<b>167.207</b>			<b>48.640</b>
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar23	0	0,00	0	450	-194,23	-609.023
S&P500 EMINI FUT Mar24	450	142,00	431.220	0	0,00	0
			<b>431.220</b>			<b>-609.023</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>598.427</b>			<b>-560.383</b>

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
<b>PB Vækst udl KL</b>						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Aktier KL	5.667.632	105,57	598.357.415	5.499.850	92,75	510.136.937
PM Lange Obligationer	492.095	92,50	45.517.016	168.626	87,23	14.709.701
PM Nye Obligationsmarkeder	226.745	85,01	19.275.230	199.392	78,86	15.723.256
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	172.246	107,22	18.467.889	166.212	96,72	16.076.839
PM Virksomhedsobligationer	81.587	93,76	7.649.548	0	0,00	0
			<b>689.267.097</b>			<b>556.646.733</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	11.674	113,96	9.917.122	11.674	101,47	8.809.017
			<b>9.917.122</b>			<b>8.809.017</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>699.184.219</b>			<b>565.455.750</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	0	0,00	0	6.589	132,60	6.497.226
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	6.372	149,47	7.099.742	5.673	153,23	6.464.141
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	255	915,97	1.741.181	228	947,50	1.606.493
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	2.218	1.183,76	19.570.613	2.693	1.149,07	23.009.772
Private Equity And Infrastructure PLC	9.195	104,82	7.184.858	0	0,00	0
Virtus GF Alphasimplex Managed Futures Fund	6.919	122,40	6.313.164	0	0,00	0
Xtrackers MSCI AC World ESG Screened UCITS ETF 1C	134.882	32,20	32.376.669	42.621	26,96	8.543.345
Xtrackers MSCI World UCITS ETF	0	0,00	0	45.941	74,85	25.572.925
			<b>74.286.226</b>			<b>71.693.903</b>
Instrumentets valuta: USD						
iShares MSCI EM IMI ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	323.742	5,49	12.384.263
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF	0	0,00	0	139.558	6,69	6.509.860

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	245	937,77	1.550.455	222	951,32	1.471.568
			<b>1.550.455</b>			<b>20.365.691</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>75.836.681</b>			<b>92.059.594</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
EURO STOXX 50 Mar23	0	0,00	0	40	-178,50	-53.096
			<b>0</b>			<b>-53.096</b>
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar23	0	0,00	0	200	-194,23	-270.677
			<b>0</b>			<b>-270.677</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>0</b>			<b>-323.773</b>

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
<b>Alternativer KL</b>						
Afdelingens funktionelle valuta: DKK						
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
PM Lange Obligationer	630.759	92,50	58.342.937	210.571	87,23	18.368.677
			<b>58.342.937</b>			<b>18.368.677</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>58.342.937</b>			<b>18.368.677</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	206.290	95,88	147.444.473	122.006	95,71	86.836.730
AQR UCITS Funds - AQR Corporate Arbitrage UCITS Fund	127.648	102,63	97.658.633	49.777	99,29	36.753.541
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	0	0,00	0	18.365	132,60	18.109.206
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	32.628	149,47	36.354.719	16.619	153,23	18.937.108
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	2.799	915,97	19.112.020	1.185	947,50	8.349.537
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	23.445	1.183,76	206.888.690	14.489	1.149,07	123.811.318
Private Equity And Infrastructure PLC	68.254	104,82	53.332.509	0	0,00	0
Virtus GF Alphasimplex Managed Futures Fund	36.886	122,40	33.656.215	0	0,00	0
			<b>594.447.259</b>			<b>292.797.440</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	713.647	14,04	67.612.436	613.287	11,73	50.116.731
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	2.973	937,77	18.814.298	1.161	951,32	7.695.901
			<b>86.426.734</b>			<b>57.812.632</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>680.873.992</b>			<b>350.610.071</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1022877 USD/DKK	0	0,00	0	-7.110.000	0,00	0
FXFO1022877 USD/DKK	0	0,00	0	49.371.840	0,29	145.576
FXFO1024212 USD/DKK	-11.887.000	0,00	0	0	0,00	0

Papirnavn	31-12-2023			31-12-2022		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
FXFO1024212 USD/DKK	80.691.928	1,00	807.964	0	0,00	0
			<b>807.964</b>			<b>145.576</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>807.964</b>			<b>145.576</b>