

# Kapitalforeningen Jyske Portefølje

## Specifikation af finansielle instrumenter

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	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	1.156.110	92,75	107.234.636	1.325.446	109,40	145.006.708
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	417.955	82,34	34.414.665	441.882	99,40	43.921.215
PM Korte Obligationer	679.930	94,95	64.558.470	874.617	100,35	87.768.078
PM Lange Obligationer	1.512.983	87,23	131.981.592	1.760.214	100,30	176.551.576
PM Nye Obligationsmarkeder	276.277	78,86	21.786.099	278.188	98,85	27.499.468
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	224.561	96,72	21.720.640	276.096	99,87	27.572.548
PM Taktisk Allokering KL	729.186	92,74	67.622.595	862.762	103,53	89.318.299
PM Virksomhedsobligationer	350.327	86,01	30.130.364	383.803	100,02	38.388.936
			<b>479.449.062</b>			<b>636.026.828</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	25.415	101,47	19.177.759	27.758	116,31	24.012.489
			<b>19.177.759</b>			<b>24.012.489</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>498.626.821</b>			<b>660.039.317</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	12.236	95,71	8.708.869	19.820	102,72	15.142.231
AQR UCITS Funds - AQR Sustainable Corporate Arbitrage UCITS Fund	6.292	99,29	4.645.786	0	0,00	0
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	2.708	132,60	2.670.282	6.207	106,54	4.918.420

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	2.444	153,23	2.784.902	5.808	114,92	4.964.248
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	207	947,50	1.458.527	0	0,00	0
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	916	1.149,07	7.827.209	1.412	1.103,31	11.586.798
			<b>28.095.574</b>			<b>36.611.697</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	96.826	11,73	7.912.451	193.990	12,24	15.533.602
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	202	951,32	1.338.994	0	0,00	0
			<b>9.251.445</b>			<b>15.533.602</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>37.347.019</b>			<b>52.145.299</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Boligejendomme A/S	22.235	178,80	3.975.618	0	0,00	0
BI Erhvervsnejendomme A/S	121.392	220,69	26.790.000	142.633	230,62	32.894.022
			<b>30.765.618</b>			<b>32.894.022</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber i alt:</b>			<b>30.765.618</b>			<b>32.894.022</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020813 USD/DKK	0	0,00	0	-2.322.500	0,00	0
FXFO1020813 USD/DKK	0	0,00	0	15.285.766	0,81	124.274
FXFO1022878 USD/DKK	-1.120.800	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1022878 USD/DKK	7.782.835	0,29	22.948	0	0,00	0
			<b>22.948</b>			<b>124.274</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>22.948</b>			<b>124.274</b>

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	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	6.758.734	92,75	626.904.345	8.253.665	109,40	902.969.109
PM Højt Ratede Virksomhedsobligationer	983.955	82,34	81.019.445	1.141.033	99,40	113.413.888
PM Lange Obligationer	3.512.434	87,23	306.399.101	4.686.334	100,30	470.044.924
PM Nye Obligationsmarkeder	563.901	78,86	44.466.977	651.037	98,85	64.356.375
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	443.601	96,72	42.907.262	622.593	99,87	62.175.748
PM Taktisk Allokering KL	2.658.477	92,74	246.539.447	3.392.449	103,53	351.206.675
PM Virksomhedsobligationer	743.145	86,01	63.915.226	934.569	100,02	93.477.928
			<b>1.412.151.804</b>			<b>2.057.644.646</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	33.721	101,47	25.445.336	36.617	116,31	31.676.104
			<b>25.445.336</b>			<b>31.676.104</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>1.437.597.141</b>			<b>2.089.320.751</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	37.943	95,71	27.005.607	60.047	102,72	45.875.153
AQR UCITS Funds - AQR Sustainable Corporate Arbitrage UCITS Fund	17.251	99,29	12.737.516	0	0,00	0
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	10.123	132,60	9.982.003	21.698	106,54	17.193.472
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	9.823	153,23	11.193.165	20.303	114,92	17.353.498
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	561	947,50	3.952.819	0	0,00	0
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	3.978	1.149,07	33.991.961	5.326	1.103,31	43.704.878
			<b>98.863.071</b>			<b>124.127.002</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	281.217	11,73	22.980.561	521.487	12,24	41.757.677
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	545	951,32	3.612.632	0	0,00	0

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
			<b>26.593.193</b>			<b>41.757.677</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>125.456.264</b>			<b>165.884.679</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Boligejendomme A/S	34.940	178,80	6.247.272	0	0,00	0
BI Erhvervsjendomme A/S	232.056	220,69	51.212.439	222.890	230,62	51.402.892
			<b>57.459.711</b>			<b>51.402.892</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber i alt:</b>			<b>57.459.711</b>			<b>51.402.892</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020814 USD/DKK	0	0,00	0	-6.243.000	0,00	0
FXFO1020814 USD/DKK	0	0,00	0	41.088.929	0,81	334.055
FXFO1022879 USD/DKK	-3.255.800	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1022879 USD/DKK	22.608.275	0,29	66.662	0	0,00	0
			<b>66.662</b>			<b>334.055</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>66.662</b>			<b>334.055</b>

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	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	7.720.259	92,75	716.090.307	7.709.376	109,40	843.422.695
PM Lange Obligationer	472.503	87,23	41.217.712	634.970	100,30	63.688.253
PM Nye Obligationsmarkeder	388.267	78,86	30.617.183	371.873	98,85	36.760.427
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	324.118	96,72	31.350.281	373.887	99,87	37.338.524
PM Taktisk Allokering KL	2.383.812	92,74	221.067.812	2.482.860	103,53	257.040.564
PM Virksomhedsobligationer	577.445	86,01	49.663.966	637.306	100,02	63.744.939
			<b>1.090.007.261</b>			<b>1.301.995.403</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	24.317	101,47	18.349.226	19.078	116,31	16.503.720
			<b>18.349.226</b>			<b>16.503.720</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>1.108.356.487</b>			<b>1.318.499.123</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	27.815	95,71	19.797.089	37.080	102,72	28.328.654
AQR UCITS Funds - AQR Sustainable Corporate Arbitrage UCITS Fund	12.646	99,29	9.337.350	0	0,00	0
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	9.840	132,60	9.702.945	14.825	106,54	11.747.314
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	8.239	153,23	9.388.220	13.994	114,92	11.961.033
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	409	947,50	2.881.823	0	0,00	0
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	3.948	1.149,07	33.735.611	3.730	1.103,31	30.608.186
			<b>84.843.039</b>			<b>82.645.187</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	205.230	11,73	16.771.024	290.095	12,24	23.229.125
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	398	951,32	2.638.216	0	0,00	0
			<b>19.409.240</b>			<b>23.229.125</b>

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>104.252.279</b>			<b>105.874.312</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber:</b>						
Instrumentets valuta: DKK						
BI Erhvervsjendomme A/S	52.315	220,69	11.545.397	30.897	230,62	7.125.466
			<b>11.545.397</b>			<b>7.125.466</b>
<b>Noterede aktier fra danske selskaber i alt:</b>			<b>11.545.397</b>			<b>7.125.466</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020815 USD/DKK	0	0,00	0	-3.473.000	0,00	0
FXFO1020815 USD/DKK	0	0,00	0	22.857.897	0,81	185.836
FXFO1022880 USD/DKK	-2.375.600	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1022880 USD/DKK	16.496.166	0,29	48.640	0	0,00	0
			<b>48.640</b>			<b>185.836</b>
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar22	0	0,00	0	450	130,70	384.665
S&P500 EMINI FUT Mar23	450	-194,23	-609.023	0	0,00	0
			<b>-609.023</b>			<b>384.665</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>-560.383</b>			<b>570.501</b>

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	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	5.499.850	92,75	510.136.937	6.007.291	109,40	657.210.851
PM Lange Obligationer	168.626	87,23	14.709.701	156.444	100,30	15.691.521
PM Nye Obligationsmarkeder	199.392	78,86	15.723.256	216.618	98,85	21.413.144
PM Nye Obligationsmarkeder Valuta	166.212	96,72	16.076.839	216.738	99,87	21.644.714
			<b>556.646.733</b>			<b>715.960.230</b>
Instrumentets valuta: EUR						
All Corporate Credit KL	11.674	101,47	8.809.017	11.674	116,31	10.098.775
			<b>8.809.017</b>			<b>10.098.775</b>
			<b>565.455.750</b>			<b>726.059.005</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>						
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	6.589	132,60	6.497.226	13.322	106,54	10.556.339
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	5.673	153,23	6.464.141	12.562	114,92	10.736.946
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	228	947,50	1.606.493	0	0,00	0
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	2.693	1.149,07	23.009.772	2.893	1.103,31	23.739.807
Xtrackers MSCI AC World ESG Screened UCITS ETF	42.621	26,96	8.543.345	44.287	31,88	10.499.235
Xtrackers MSCI World UCITS ETF	45.941	74,85	25.572.925	50.640	86,66	32.640.260
			<b>71.693.903</b>			<b>88.172.587</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	0	0,00	0	73.107	12,24	5.853.988
iShares Core MSCI EM IMI UCITS ETF	0	0,00	0	67.366	35,66	15.709.254
iShares MSCI EM IMI ESG Screened UCITS ETF	323.742	5,49	12.384.263	0	0,00	0
iShares MSCI World ESG Screened UCITS ETF	139.558	6,69	6.509.860	161.158	8,33	8.775.717
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	222	951,32	1.471.568	0	0,00	0

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi	Antal stk.	Børskurs	Kursværdi
			<b>20.365.691</b>			<b>30.338.959</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>92.059.594</b>			<b>118.511.545</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1020816 USD/DKK	0	0,00	0	-875.230	0,00	0
FXFO1020816 USD/DKK	0	0,00	0	5.760.414	0,81	46.832
			<b>0</b>			<b>46.832</b>
Instrumentets valuta: EUR						
EURO STOXX 50 Mar22	0	0,00	0	130	136,00	131.496
EURO STOXX 50 Mar23	40	-178,50	-53.096	0	0,00	0
			<b>-53.096</b>			<b>131.496</b>
Instrumentets valuta: JPY						
NIKKEI 225 (SGX) Mar22	0	0,00	0	2.000	975,00	110.751
			<b>0</b>			<b>110.751</b>
Instrumentets valuta: USD						
S&P500 EMINI FUT Mar22	0	0,00	0	900	130,70	769.330
S&P500 EMINI FUT Mar23	200	-194,23	-270.677	0	0,00	0
			<b>-270.677</b>			<b>769.330</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>-323.773</b>			<b>1.058.409</b>

Papirnavn	31-12-2022			31-12-2021		
	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	210.571	87,23	18.368.677	0	0,00	0
			<b>18.368.677</b>			<b>0</b>
<b>Inv-beviser i andre danske UCITS i alt:</b>			<b>18.368.677</b>			<b>0</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger:</b>						
Instrumentets valuta: EUR						
AB SICAV I - Event Driven Portfolio	122.006	95,71	86.836.730	0	0,00	0
AQR UCITS Funds - AQR Sustainable Corporate Arbitrage UCITS Fund	49.777	99,29	36.753.541	0	0,00	0
Natixis International Funds Lux I - ASG Managed Futures Fund	18.365	132,60	18.109.206	0	0,00	0
Aspect UCITS Funds PLC - Aspect Diversified Trends	16.619	153,23	18.937.108	0	0,00	0
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund QE	1.185	947,50	8.349.537	0	0,00	0
Crown Alpha PLC - LGT Multi-Alternatives Sub-Fund	14.489	1.149,07	123.811.318	0	0,00	0
			<b>292.797.440</b>			<b>0</b>
Instrumentets valuta: USD						
GAM FCM ILS Return Fund	613.287	11,73	50.116.731	0	0,00	0
LGT Dynamic Protection UCITS Sub-Fund PU	1.161	951,32	7.695.901	0	0,00	0
			<b>57.812.632</b>			<b>0</b>
<b>Inv-beviser i udenlandske investeringsforeninger i alt:</b>			<b>350.610.071</b>			<b>0</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter:</b>						
Instrumentets valuta:						
FXFO1022877 USD/DKK	-7.110.000	0,00	0	0	0,00	0
FXFO1022877 USD/DKK	49.371.840	0,29	145.576	0	0,00	0
			<b>145.576</b>			<b>0</b>
<b>Afledte finansielle instrumenter i alt:</b>			<b>145.576</b>			<b>0</b>