



CAPTOR

Captor Iris Bond

Förvaltarkommentar - April 2019

Förvaltarkommentar

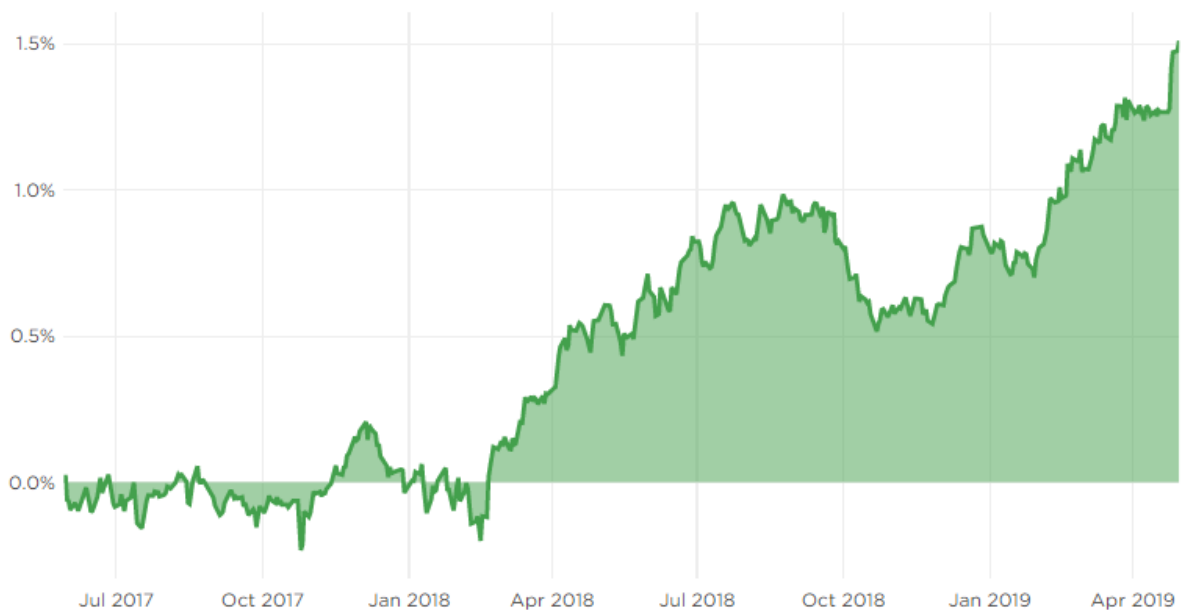
Februari 2019

Ränterörelserna var små under månaden, under perioden steg 10-årig swapränta med ca en och en halv punkt och slutade den 30:e på 85 bp. Bospreadar gick ihop med ca 3 punkter under perioden. Sammanlagt var det ett gynnsamt förhållande för fonden som noterade all time high under månaden.

Värdeutveckling



RELATIV AVKASTNING



Värde	2 083 092 168	Beta	1,04
Årsavkastning, portfölj	3,69%	Korrelation mot benchmark	0,99
Årsavkastning, benchmark	2,96%	Tracking error	0,5%
Diff	0,73%	Informationskvot	1,48
Volatilitet, portfölj	3,5%	Sharpekvot	1,27
Volatilitet, benchmark	3,3%	Andel positiva månader	71%

AVKASTNING (%)

	1M	3M	6M	1Y	3Y	5Y
Captor Iris Bond	0,4%	2,4%	5,3%	6,3%		
SEK Swap Basket TR	0,2%	1,7%	4,4%	5,3%		
DIFF	0,2%	0,7%	0,8%	0,9%		

	2019	2018	2017
Captor Iris Bond	3,6%	4,1%	-0,2%
SEK Swap Basket TR	3,0%	3,2%	-0,2%
DIFF	0,6%	0,9%	-0,0%

AVKASTNING PER MÅNAD (%)

	jan feb	mar apr	maj jun	jul aug	sep okt	nov dec
2019	1,2% 0,2%	1,8% 0,4%				
2018	-1,2% 1,3%	1,3% 0,1%	1,2% 0,5%	-0,8% 1,1%	-1,2% 0,1%	1,3% 0,4%
2017			0,3% -1,9%	-0,2% 1,4%	-0,8% 1,2%	0,7% -1,0%

Genomlysning

Kreditdurationen är för närvarande 4,11 år och den genomsnittliga kreditspreaden mot statsobligationer är 66 bp. Yield to Maturity är 36bp.

Ränteduration är 10,89 år

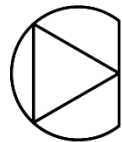


Daniel Karlgren

Förvaltare

+ 46 76 117 33 50

Daniel.karlgren@captor.se



CAPTOR

Ansvarsbegränsning

Detta material är producerat av Captor Investment Management AB. De som tagit fram innehållet är inte analytiker och materialet är inte oberoende investeringsanalys.

Innehållet är uteslutande avsett för kunder i Norden. Syftet är att ge en allmän information om Captor Investment Management AB och utgör inte ett personligt investeringsråd eller en personlig rekommendation. Informationen ska inte ensamt utgöra underlag för investeringsbeslut. Kunder bör inhämta råd från sina rådgivare och basera sina investeringsbeslut utifrån egen erfarenhet.

Ett finansiellt instruments historiska avkastning är inte en garanti för framtida avkastning. Värdet på finansiella instrument kan båda öka och minska och det är inte säkert att hela det investerade kapitalet återfås.