



CAPTOR

Halvårsredogörelse för
Captor Dahlia Green Bond
515602-9885

2021-06-30

Förvaltningsberättelse

Fondens inriktning

Fonden är en räntefond som placerar i obligationer och andra räntebärande finansiella instrument i svenska kronor och utländsk valuta.

Fonden placerar huvudsakligen kapitalet i så kallade gröna obligationer. Med gröna obligationer avses obligationer och andra räntebärande finansiella instrument med hållbarhets-teman som till exempel green bonds, social bonds och sustainability bonds.

Fondens målsättning är att med hänsyn tagen till fondens placeringsinriktning uppnå bästa möjliga riskjusterade avkastning. Fonden passar andelsägare som har längre placeringshorisont än 2 år.

Förvaltningsresultat

Fondförmögenheten har ökat från 1190 mkr till 1414 mkr under första halvåret 2021. Avkastningen var 1,5%.

Inledningen av året gick i inflationsorons tecken. Långa räntor steg kraftigt då inflationen förväntades ta fart efter de stimulanser och stödåtgärder som satts in för att rädda ekonomin under Covid-19-pandemin. Förväntningarna om stigande inflation har än så länge inte materialiserats och ränteuppgången stannade av under andra kvartalet. Den gröna obligationsmarknaden växte under halvåret, nya emittenter tillkom kontinuerligt under perioden. Kreditspreadar har under halvåret gått ihop något. Svensk fyraårig swapränta steg under halvåret från 0,08% till 0,28%.

Riskutnyttjande

Riskenivån har under första halvåret kontinuerligt legat på kvalitetsranking A enligt Morningstars "Average credit Quality Methodology".

Fondens risker

Fonden placerar i räntebärande värdepapper vilket generellt kännetecknas av lägre risk än aktiemarknaden.

Fonden är utsatt för motpartsrisk, alltså risken att motparten inte kommer uppfylla sina

skyldigheter till fonden. Det kan exempelvis ske genom att motparten inte betalar ett förbestämt belopp eller att inte leverera värdepapper i enighet med ett avtal. Om möjligt handlas derivatinstrument med en central motpart och säkerställs på daglig basis. För derivat som handlas enligt bilaterala avtal krävs motsvarande säkerhetshantering.

Teckning och inlösen i fonden kan skapa likviditetsrisk för fonden om vissa instrument är illikvida. Marginalsäkerhetskrav avseende derivatinstrument samt risken att kunder inte betalar i tid kan också utgöra likviditetsrisk. Fonden hanterar risken genom löpande likviditetsprognos och möjlighet att bryggfinansiera genom värdepappersutlåning.

Handel med derivatinstrument

I enlighet med fondbestämmelserna använder fonden huvudsakligen räntederivat för att upprätthålla räntebindningstiden. Det har under året gjorts med central clearingmotpart för säkerställande av exponeringen samt även bilaterala, säkerställda, derivat.

Fonden får enligt fondbestämmelserna utnyttja värdepapperslån. Fonden har i mindre utsträckning använt värdepapperslån under året.

Värderingsprinciper

Fondens finansiella instrument inklusive skulder och derivat värderas till marknadsvärde motsvarande avslutspris på balansdagen (2021-06-30). Om balansdagen inte är handelsdag, används pris från senaste handelsdagen före balansdagen. Om pris inte kan erhållas, eller är missvisande enligt fondbolagets bedömning, får värdering ske på objektiv grund enligt allmänt vedertagna värderingsprinciper.

Genomlysning

Kreditdurationen vid halvårsskiftet var 4,88 år och den genomsnittliga kreditspreaden mot statsobligationer var 97 bp.

Hållbarhetsinformation

Transparens i fråga om integrering av hållbarhetsrisker, om främjandet av miljörelaterade eller sociala egenskaper, och om hållbar investering

- Fonden har hållbar investering som mål
- Fonden främjar bland annat miljörelaterade eller sociala egenskaper
- Hållbarhetsrisker beaktas i investeringsbeslut, utan att fonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper eller har hållbar investering som mål
- Hållbarhetsrisker är inte relevanta (förklaring nedan)

Hur uppnås dessa egenskaper?

Hållbarhet för Captor innebär att vi tar hänsyn till ESG frågor vid investeringsbeslut. Captor använder sig av tre olika metoder vid hänsyn av ESG frågor: välja in, välja bort och att påverka. Hur vi sedan hanterar dessa beror på fondens inriktning, tillgångsslag och strategi.

Fonden har hållbar investering som mål. Fonden integrerar miljö-, sociala och bolagsstyrningsfaktorer i investeringsprocessen och vid investeringsbeslut. Fondens metod och information om hur dessa egenskaper uppnås finns under stycket "Metod som används"

Captor Dahlia Green Bonds mål är att investera i gröna obligationer. Fonden placerar huvudsakligen kapitalet i gröna obligationer men också i obligationer och andra räntebärande finansiella instrument med olika hållbarhetsteman så som social bonds eller sustainability bonds. Hållbarhetsarbetet och information om hur fondernas hållbarhetsegenskaper uppfylls rapporteras i respektive fonds årsrapport och finns tillgängliga på hemsidan. Vidare rapporterar Captor årligen en sammanställning av fondens investeringar, innehavens positiva hållbarhetseffekter och case-studies med olika bolag. Bolaget arbetar kontinuerligt med att öka den aggregerade datan över hållbarhetseffekterna. Exempelvis genom att

visa hur fondens innehav fördelar sig över den 17 globala målen, fördelningen över olika hållbara projektkategorier och när möjligt data på minskade utsläpp.

Hållbarhetsrisker

En hållbarhetsrisk innebär miljörelaterade, sociala eller styrningsrelaterade händelser eller förhållanden som, om de förverkligas, skulle kunna ha en negativ inverkan på investeringens värde. Genom att exkludera olika typer av bolag i investeringsbeslut-processen minskas hållbarhetsriskerna. Captor exkluderar bolag där bolaget identifierat tydliga hållbarhetsrisker, exempelvis bolag som bryter mot klimatrelaterade normer och konventioner. Detta för att Captor ser en risk för att sådana bolag får negativa konsekvenser som ryktesrisk eller ökade kostnader som böter. Fonden beaktar riskerna vid investeringsbeslut och kontrollerar sedan löpande fondens innehav. Detta sker genom en intern och extern analys från bolagets leverantör av ESG data.

Captor Dahlia Green Bond investerar i obligationer och andra räntebärande instrument vilket innebär att fondbolaget inte kan nyttja rösträtten. Fondbolaget har fortfarande kontakt med bolag och andra marknadsintressenter för att påverka dessa samt för att skapa ett kunskapsutbyte över flera hållbarhetsfrågor och på så vis minska olika hållbarhetsrisker.

Vad är den troliga inverkan på avkastning för de finansiella produkterna?

Hållbarhetsrisker kan påverka fondens avkastning om de materialiseras inom flertalet olika hänseenden. Om ett bolag i fonden inte når fondens hållbarhetskriterier så säljs detta innehav av för att minska risken för inverkan på avkastningen. Fonden investerar i så kallade omställningsbolag vilket medför risk för att bolaget inte lyckas göra en omställning. Fonden kan då påverkas av att tillgången sjunker i värde.

Hållbarhetsrelaterade egenskaper som främjas i förvaltningen av fonden, eller som ingår i fondens målsättning

- Miljörelaterade egenskaper
- Sociala egenskaper

- Praxis för god styrning
- Andra hållbarhetsrelaterade egenskaper

Fondbolagets kommentar: *Fondens mål är att investera i gröna obligationer. Fonden placerar huvudsakligen kapitalet i gröna obligationer men också i obligationer och andra räntebärande finansiella instrument med olika hållbarhetsteman såsom social bonds eller sustainability bonds. Genom att investera i gröna-, sociala- och hållbara obligationer så främjar fonden exempelvis egenskaper som biologisk mångfald, förnyelsebar energi, anpassning till klimatförändringar och tillgång till grundläggande infrastruktur.*

Referensvärden

Fonden har följande hållbarhetsindex som referensvärde:

Inget hållbarhetsindex har valts som referensvärde.

Fondbolagets kommentar: Inget specifikt hållbarhetsindex har valts ut för att användas som underlag för urval av fondens placeringar. Fonden använder sig dock av ett index för att jämföra risk- och avkastning. Förvaltaren gör aktiva val i fonden så att den uppnår de miljörelaterade och sociala egenskaper som fonden eftersträvar. Mer information finns nedan.

Metod som används för att integrera hållbarhetsrisker, främja miljörelaterade eller sociala egenskaper eller för att uppnå ett hållbarhetsrelaterat mål

Fonden väljer in

Fondbolagets kommentar: *Hållbarhetsaspekter är avgörande för förvaltarens val av bolag. Fonden placerar kapitalet i gröna obligationer men också i obligationer och andra räntebärande instrument med olika hållbarhetsteman såsom sociala- och hållbara obligationer. Fonden omfattar exempelvis projekt inom förnyelsebar energi, gröna byggnader och anpassning till klimatförändringar.*

Fonden väljer bort

Fondbolagets kommentar: *Fonden placerar inte i bolag som är involverade i följande produkter och tjänster.*

Klusterbomber, personminor
Fondbolagets kommentar: 0%

Kemiska och biologiska vapen
Fondbolagets kommentar: 0%

Kärnvapen
Fondbolagets kommentar: 0%

Vapen och/eller krigsmateriel
Fondbolagets kommentar: 5%

Alkohol
Fondbolagets kommentar: Produktion 5%

Tobak
Fondbolagets kommentar: Produktion 5%

Kommersiell spelverksamhet
Fondbolagets kommentar: Drift och verksamhet 5%
Skräddarsydd utrustning/tillbehör 5%.

Pornografi
Fondbolagets kommentar: Produktion 5%

Fossila bränslen (olja, gas, kol)
Fondbolagets kommentar: Fonden exkluderar inte fossila bränslen för att möjliggöra investeringar i omställningsbolag där vi ser långsiktiga och positiva miljöeffekter.

Internationella normer

Internationella normer avser internationella konventioner, lagar och överenskommelser såsom FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag som rör frågor om miljö, mänskliga rättigheter, arbetsvillkor och affärsetik.

Fonden investerar inte i bolag som kränker internationella normer.

Fondbolagets kommentar: *Med Sustainability screeningverktyg kan vi identifiera bolag som systematiskt bryter mot internationella normer och konventioner som omfattas av bland annat FN Global Compact samt OECD:s riktlinjer för multinationella företag. De bolag som bryter mot dessa normer ska som regel säljas av.*

Fonden investerar inte i bolag som inte vidtar åtgärder för att komma till rätta med identifierade problem eller där fonden bedömer att bolagen inte kommer att komma tillrätta med problemen under en tid som fondbolaget bedömer som rimlig i det enskilda fallet.

Fondbolagets kommentar: *Detta alternativ avser fonder som tar fram en handlingsplan för ifrågasatta bolag, som exkluderas om angivna villkor inte uppfylls under utsatt tidsperiod.*

Fondbolaget påverkar

Fondbolaget använder sitt inflytande för att påverka bolag i hållbarhetsrelaterade frågor.

Fondbolaget har kontakt med bolag i syfte att påverka dem i en mer hållbar riktning.

- Bolagspåverkan i egen regi
- Bolagspåverkan i samarbete med andra investerare
- Bolagspåverkan genom externa leverantörer/konsulter
- Deltar i valberedning för att påverka sammansättning
- Annan bolagspåverkan

Fondbolagets kommentar: *Fondbolaget använder sitt inflytande för att påverka bolag i hållbarhetsfrågor. Fondbolaget har kontakt med bolag och andra marknadsintressenter i syfte att skapa ett kunskapsutbyte påverka dem i en mer hållbar riktning.*

Fonden är en räntefond och investerar i räntebärande värdepapper som exempelvis

statsobligationer, bostadsobligationer och företagscertifikat. Räntefonder har inget aktieinnehav vilket innebär att fondbolaget inte kan rösta på bolagsstämmor, men i övrigt kan fondbolaget påverka i hållbarhetsfrågor.

Resurser

- Fonden använder interna resurser för hållbarhetsanalys och bolagspåverkan
- Fonden använder externa resurser för hållbarhetsanalys och bolagspåverkan

Fondbolagets kommentar: *Captor använder Sustainalytics som extern leverantör av ESG data. Sustainalytics tillhandahåller Bolaget med data som ligger till grund för bolagets hantering av hållbarhetsrisker. Hur datan används beror på fondens inriktning, tillgångsslag och hållbarhetsmetod. Bolagen kontrolleras så att de ligger i linje med respektive fonds hållbarhetskrav innan en investering, sedan sker en kontinuerlig granskning av fondernas innehav.*

Övrigt

Ytterligare information

Fondbolaget publicerar årligen en hållbarhetsrapport
Fondbolagets kommentar: *Information om Captors löpande arbete med ansvarsfulla investeringar återfinns bland annat på hemsidan och i årsrapporterna.*

Övrigt

Fondbolagets kommentar: *Captor rapporterar årligen till PRI gällande sitt arbete med ansvarsfulla investeringar.*

Balansräkning

Belopp i tkr	2021-06-30	2020-12-31
TILLGÅNGAR		
Överlåtbara värdepapper	1 397 701	1 112 006
OTC-derivatinstrument med positivt marknadsvärde	6 804	9 269
Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde	1 404 505	1 121 275
Bankmedel och övriga likvida medel	11 705	76 267
Förutbetalda kostnader och upplupna Intäkter	4 318	3 376
Övriga tillgångar	5 621	4 775
Summa tillgångar	1 426 148	1 205 693
SKULDER		
OTC derivatinstrument med negativt marknadsvärde	6 593	3 892
Övriga skulder	5 028	210
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter	338	11 222
Summa skulder	11 959	15 324
FONDFÖRMÖGENHET	1 414 189	1 190 369

POSTER INOM LINJEN, tkr	2021-06-30	2020-12-31
Mottagna säkerheter för OTC-derivatinstrument	2 972	11 213
Ställda säkerheter för OTC-derivatinstrument	19 019	19 002

Förändring av fondförmögenhet

Belopp i tkr	2021-06-30	2020-12-31
Fondförmögenhet vid årets början	1 190 369	834 840
Andelsutgivning	263 462	356 414
Andelsinlösen	-35 081	-23 233
Årets resultat enligt resultaträkningen	-4 560	22 348
Fondförmögenhet vid årets slut	1 414 189	1 190 369

Fondens innehav

Värden är beräknade i SEK

Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad			
Hållbara obligationer	Antal/nominellt belopp	Marknadsvärde tkr	% av fondförm.
ADSGR 0 10/05/28	1 000 000	10 047	0,71
AIB 0 1/2 11/17/27	3 000 000	30 441	2,15
AIFP 0 3/8 05/27/31	1 500 000	15 367	1,09
ALLRNV 0 7/8 06/24/32	1 000 000	10 611	0,75
ATRLJB Float 02/03/26	20 000 000	19 978	1,41
BASGR 0 1/4 06/05/27	2 500 000	25 727	1,82
BNP 0 3/8 10/14/27	1 000 000	10 159	0,72
BNP 1 1/8 08/28/24	1 500 000	15 880	1,12
BNRFST Float 05/06/26	32 000 000	32 091	2,27
BUSKEN Float 09/30/25	12 000 000	11 974	0,85
CMZB 0 3/4 03/24/26	500 000	5 163	0,37
DAIGR 0 3/4 09/10/30	1 500 000	15 723	1,11
DB 1 3/8 06/10/26	600 000	6 382	0,45
DEVOBA 0 1/4 06/22/26	2 000 000	20 116	1,42
DNBNO 0 3/4 01/31/24	20 000 000	20 379	1,44
EIDSIV 2 3/8 05/26/31	24 000 000	23 790	1,68
EIDSIV Float 10/02/25	18 000 000	17 997	1,27
ELLEVI Float 06/11/27	15 000 000	15 543	1,10
ELTLX 1.103 03/27/24	23 000 000	23 486	1,66
ENEXIS 0 5/8 06/17/32	1 000 000	10 291	0,73
ENGIFP 0 3/8 06/21/27	200 000	2 056	0,15
ENTRAN 0 05/22/25	12 000 000	12 004	0,85
ENTRAN Float 06/29/27	8 000 000	8 100	0,57
EOANGR 0 08/28/24	1 500 000	15 220	1,08
EOANGR 0 3/8 09/29/27	2 000 000	20 553	1,45
ESBIRE 1 1/8 06/11/30	400 000	4 290	0,30
EUROGR 1.113 05/15/32	500 000	5 341	0,38
FABGSS 0 09/03/25	16 000 000	16 439	1,16
FABGSS 1.265 02/02/27	8 000 000	7 938	0,56
FABGSS Float 02/02/26	20 000 000	20 023	1,42
FABGSS Float 09/10/24	6 000 000	6 082	0,43
FASTIG 0 03/01/24	10 000 000	10 130	0,72
FASTIG Float 12/08/25	10 000 000	10 021	0,71
FERROV 1 1/8 07/09/26	1 000 000	10 757	0,76
FSTSTN Float 05/28/26	10 000 000	9 983	0,71
FVHSAM 0.893 09/11/26	26 000 000	26 009	1,84
FVHSAM 1.395 05/11/28	8 000 000	8 024	0,57
GOTA Float 06/03/26	10 000 000	10 481	0,74
HEBAB Float 03/02/26	24 000 000	24 004	1,70
HEIBOS 1.368 02/25/25	6 000 000	6 104	0,43
HEMSOF Float 11/25/25	20 000 000	20 021	1,42
HUMFAS Float 10/07/26	24 000 000	24 569	1,74

JERNAB 0.938 04/18/24	20 000 000	20 371	1,44
JFM 0.01 02/02/28	500 000	5 056	0,36
KBN 0 1/8 08/28/26	10 000 000	9 850	0,70
KLED Float 01/15/27	8 000 000	8 106	0,57
KLED Float 09/25/26	16 000 000	16 188	1,15
KLED Float 12/06/24	6 000 000	6 048	0,43
KLOVSS Float 04/16/24	15 000 000	15 329	1,08
KOMINS 0 1/4 11/26/27	15 000 000	14 713	1,04
KUNTA 0.05 09/10/35	1 600 000	15 593	1,10
LANHYP 0.615 11/18/25	18 000 000	18 244	1,29
LATMEK 1.115 04/27/26	20 000 000	20 108	1,42
LJGRB 0 08/21/24	8 000 000	8 131	0,58
LKAB Float 03/10/25	10 000 000	10 060	0,71
LPTY 1 3/8 03/07/24	1 000 000	10 558	0,75
MINGNO 0.01 02/18/28	3 000 000	29 681	2,10
NDASS 0 1/2 03/19/31	1 700 000	17 217	1,22
NIB 0 3/8 02/01/24	6 000 000	6 046	0,43
NORGRU 0 02/12/24	7 000 000	7 044	0,50
NRSKTO Float 03/11/25	4 000 000	3 966	0,28
NYKRE Float 10/01/24	25 000 000	25 578	1,81
OSTKOM Float 06/23/25	5 000 000	5 150	0,36
PNLNA 0 5/8 09/23/26	1 000 000	10 379	0,73
RABOBK 0 1/4 10/30/26	1 500 000	15 381	1,09
RDKRE Float 10/01/24	25 000 000	25 443	1,80
REESM 0 3/8 07/24/28	500 000	5 164	0,37
RIKSHM 0.595 01/19/26	20 000 000	19 803	1,40
RIKSHM Float 02/03/25	15 000 000	15 033	1,06
RIKSHM Float 02/17/26	15 000 000	14 899	1,05
SAGAX Float 06/16/23	6 000 000	6 029	0,43
SALMNO Float 01/22/27	11 200 000	11 303	0,80
SATOYH 1 3/8 02/24/28	1 000 000	10 556	0,75
SBAB 0 06/20/24	16 000 000	16 234	1,15
SBAB 0 3/4 03/28/24	22 000 000	22 426	1,59
SCABSS 1 3/8 06/21/28	24 000 000	23 923	1,69
SCANIA Float 01/20/25	17 000 000	17 092	1,21
SCBNOR Float 05/12/23	7 000 000	7 046	0,50
SCMNVX 0 3/8 11/14/28	100 000	1 028	0,07
SHBASS 0.01 12/02/27	2 000 000	19 940	1,41
SKABSS 0 05/24/23	18 000 000	18 060	1,28
SKANEB Float 10/21/24	10 000 000	10 141	0,72
SKBKH Float 12/02/24	14 000 000	14 241	1,01
SKFBSS 0 7/8 11/15/29	600 000	6 328	0,45
SPABOL Float 06/02/25	18 000 000	18 476	1,31
SPOLNO 0 1/8 03/03/28	2 250 000	22 509	1,59
SRGIM 0 3/4 06/17/30	3 000 000	30 820	2,18
SRGIM 1 1/4 08/28/25	500 000	5 363	0,38
STATNE Float 06/30/23	8 000 000	7 986	0,56

STERV 0 02/20/24	14 000 000	14 405	1,02
STERV 0 5/8 12/02/30	100 000	1 012	0,07
STERV Float 04/29/25	10 000 000	10 649	0,75
SWED 0 1/8 09/09/30	3 390 000	3 357	0,24
TELEFO 1.069 02/05/24	100 000	1 046	0,07
UNPRFI 1 7/8 11/02/23	1 400 000	14 785	1,05
VACSEA 0 06/03/24	8 000 000	8 197	0,58
VACSEA 0 09/12/23	16 000 000	16 381	1,16
VACSEA Float 03/24/28	24 000 000	23 989	1,70
VATFAL 0 1/2 06/24/26	600 000	6 205	0,44
VATFAL 0 1/8 02/12/29	12 000 00	11 967	0,85
VOLVAB 0.858 11/20/25	8 000 000	8 058	0,57
VOLVAB Float 03/18/24	12 000 000	12 156	0,86

Summa hållbara obligationer 1 400 136 99

Summa överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller motsvarande marknad utanför EES 99

Övriga finansiella instrument

Ränteswappar	Valuta	Nominellt belopp	Marknadsvärde, tkr	% av fondförm.
IRS	EUR	2 500 000	-563	-0,04
IRS	EUR	4 000 000	-998	-0,07
IRS	EUR	15 000 000	-19	0,00
IRS	EUR	3 300 000	-554	-0,04
IRS	EUR	3 000 000	47	0,00
IRS	SEK	80 000 000	1407	0,10
IRS	SEK	60 000 000	-166	-0,01
IRS	SEK	140 000 000	1513	0,11
IRS	SEK	70 000 000	-1482	-0,10
IRS	SEK	50 000 000	-738	-0,05
IRS	SEK	80 000 000	-1078	-0,08
IRS	SEK	110 000 000	899	0,06
IRS	SEK	45 000 000	723	0,05
Summa ränteswappar			-1 007	-0,07

Valuta forward	Valuta	Nominellt belopp	Marknadsvärde, tkr	% av fondförm.
FXS	EUR	1	-9	0,00
FXS	EUR	1	1 902	0,13
FXS	NOK	1	212	0,01
FXS	NOK	1	-176	-0,01
FXS	NOK	1	1 028	0,07

FXS	NOK	1	49	0,00
FXS	SEK	-1	0.02	0,00
FXS	SEK	1	-0.02	0,00
Summa valuta forward			3 006	0,21
Swaptioner	Valuta	Nominellt belopp	Marknadsvärde, tkr	% av fondförm.
Swaption	SEK	50 000 000	-244	-0.02
Summa övriga finansiella instrument			1 755	0,12
Summa finansiella instrument			1 401 891	99,1
Övriga tillgångar och skulder			12 297	0,9
Total fondförmögenhet			1 414 189	100

De tio största emittenterna i fonden

Emittent	% av fondförmögenhet
SNAM S.P.A.	3.1
E.ON SE	3.0
Sveriges Säkerställda Obligationer AB	2.9
DNB Boligkredit AS	2.6
Vasakronan AB	2.5
SKB	2.4
BNP	2.2
Stockholm Exergi Holding AB	2.2
Stora Enso Oyj	2.2
BASF SE	2.2

Nyckeltal

Fondens utveckling	2021-06-30	2020-12-31	2019-12-31
Fondförmögenhet, mkr	1 414	1 190	835
- varav klass A	3	3	1
- varav klass B	44	77	20
- varav klass C	1 367	1 110	814
- varav klass D	0,01		
Andelsvärde klass A, kr	303	304,51	299,48
Andelsvärde klass B, kr	205	205,56	201,76
Andelsvärde klass C, kr	105	104,82	102,72
Andelsvärde klass D, kr	1 010		
Antal utestående andelar, tusental	13 306	10 974	8 025
- varav klass A	9,8725532	12	3
- varav klass B	214,5020104	375	100
- varav klass C	13 081,82334	10 587	7 922

- varav klass D	0,01		
Totalavkastning Dahlia Green Bond, %	-0,3	2,0	3,2
Totalavkastning jämförelseindex*, %	0,1	1,9	1,4

*Dahlia Green Bonds jämförelseindex är NOMX Credit SEK Total Return.

Risk- och avkastningsmått	2021-06-30	2020-12-31	2019-12-31
Total risk Dahlia Green Bond, %	3,5	4,1	1,7
Total risk jämförelseindex, %	1,7	2,1	11,0
Korrelation mot benchmark, %	99	99	96
Tracking error, %	2,2	2,2	0,8
Informationskvot	0,03	0,44	1,66
Sharpekvot	0,28	0,73	1,43
Duration, år	4,9	4,5	4,7
Andel positiva månader, %	67	79	50
Genomsnittlig årsavkastning Dahlia Green Bond (2 år), %	0,83	2,04	3,19
Genomsnittlig årsavkastning Dahlia Green Bond (sedan start), %	1,5	1,9	1,8

Riskmåttan grundar sig på två års historik (24 observationer). 2019 saknar två års historik, riskmåttan beräknas istället från fondens startdatum.

Kostnader	2021-06-30*	2020-12-31	2019-12-31
Förvaltningsavgift klass A, %	0,6	0,6	0,6
Förvaltningsavgift klass B, %	0,4	0,4	0,4
Förvaltningsavgift klass C, %	0,25	0,25	0,25
Transaktionskostnader, tkr	67	67	71
Transaktionskostnader, %	0,005	0,006	0,009
Insättning och uttagsavgift klass A, %	0	0	0
Insättning och uttagsavgift klass B, %	0	0	0
Insättning och uttagsavgift klass C, %	0-2	0-2	0-2
Förvaltningskostnad för Klass C beräknad för engångs-insättning om 10 000 kr	25,47	25,56	25,85

*Avser kostnader för de senaste 12 månaderna.

Övrig information	2021-06-30	2020-12-31	2019-12-31
Omsättningshastighet	0,2	0,4	0,9
Utdelning		Fonden lämnar ingen utdelning	