



### § 1 Fondens namn och rättsliga ställning

Fondens namn är Captor Dahlia Green Bond ("Fonden"). Fonden är en värdepappersfond enligt lagen (2004:46) om värdepappersfonder ("LVF").

Fonden kan inte förvärva rättigheter eller ikläda sig skyldigheter eller föra talan inför domstol eller annan myndighet. Egendom som ingår i Fonden får inte utmätas och andelsägarna svarar inte för förpliktelser som avser Fonden. Fondbolaget företräder andelsägarna i frågor som rör Fonden, beslutar över den egendom som ingår i Fonden samt utövar de rättigheter som härrör ur Fonden.

Fondförmögenheten ägs av fondandelsägarna gemensamt och varje andel i en andelsklass medför lika rätt till den egendom som ingår i fonden. Fonden består av andelsklasser vilket innebär att värdet av en fondandel i en andelsklass kommer att skilja sig åt från värdet av en fondandel i en annan klass.

Verksamheten bedrivs enligt dessa fondbestämmelser, fondförvaltarens bolagsordning, LVF och övriga tillämpliga författningar.

Fonden består av följande andelsklasser:

**Andelsklass A:** Högsta fasta arvode om 0,60 procent. Första insättning måste uppgå till minst 100 SEK.

**Andelsklass B:** Högsta fasta arvode om 0,40 procent. Första insättning måste uppgå till minst 1 000 000 SEK.

**Andelsklass C:** Högsta fasta arvode om 0,25 procent. Första insättning måste uppgå till minst 10 000 000 SEK.

**Andelsklass D:** Fast arvode om 0,25 procent.

Första insättning måste uppgå till minst 1 000 000 EUR. Andelsklass D är valutasäkrad till EUR, vilket innebär att andelsklassens valutaexponering är säkrad från fondens basvaluta (SEK) till EUR.

Valutasäkringens syfte är att begränsa effekten relaterad till fluktuationer i växelkursen mellan basvalutan (SEK) och andelsklassens referensvaluta (EUR). Vinstökning eller förlust samt kostnader relaterad till denna valutasäkring är endast allokerad till Andelsklass D och påverkar inte till fondens övriga andelsklasser.

**Andelsklass E:** Fast arvode om 0,25 procent.

Första insättning måste uppgå till minst 10 000 000 SEK. Andelsklass E är utdelande. Se § 12 för villkor gällande utdelning.

### § 2 Fondförvaltare

Fonden förvaltas av Captor Fund Management AB, org. nr. 559051-3189 ("Fondbolaget").

### § 3 Förvaringsinstitutet och dess uppgifter

Fondens tillgångar förvaras av Swedbank AB (publ) med organisationsnummer 502017-7753 såsom förvaringsinstitut. Förvaringsinstitutet ska verkställa de beslut av Fondbolaget som inte strider mot bestämmelser i LVF eller fondbestämmelserna. Förvaringsinstitutet ska vidare ta emot och förvara den egendom som ingår i Fonden samt tillse att;

- ▷ teckning och inlösen av andelar sker i enlighet med lag och fondbestämmelser,
- ▷ värdet av fondandelarna beräknas enligt lag och fondbestämmelser,
- ▷ tillgångarna i Fonden utan dröjsmål kommer förvaringsinstitutet tillhanda, och
- ▷ medlen i Fonden används enligt bestämmelserna i lag och fondbestämmelser.

## § 4 Fondens karaktär

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

Fonden placerar huvudsakligen kapitalet i så kallade gröna obligationer, med vilket avses obligationer och andra räntebärande finansiella instrument med olika hållbarhetsteman så som green bonds, social bonds och sustainability bonds. Mer information om vad som avses med gröna obligationer återfinns i informationsbroschyren.

Fondens målsättning är att med hänsyn tagen till fondens placeringsinriktning, uppnå bästa möjliga riskjusterade avkastning.

Fonden förvaltas i enlighet bolagets policy för ansvarsfulla investeringar. Mer information finns på [www.captor.se](http://www.captor.se).

## § 5 Fondens placeringsinriktning

Fondens medel får placeras:

- ▷ i överlåtbara värdepapper,
- ▷ i penningmarknadsinstrument,
- ▷ i fondandelar,
- ▷ på konto hos kreditinstitut, och
- ▷ i derivatinstrument.

Fondens kapital placeras med en målsättning om att uppnå 100% gröna obligationer. Vid var tid placeras minst 50% av fondens kapital i gröna obligationer. Med gröna obligationer avses obligationer och andra räntebärande finansiella instrument med olika hållbarhetsteman så som green bonds, social bonds och sustainability bonds. Gröna obligationer emitteras av såväl företag som kommuner, stater, internationella organisationer m.fl. Mer information om fondens hållbarhetsarbete samt vad som avses med gröna obligationer återfinns i informationsbroschyren.

Minst 70 procent av fondens medel placeras i obligationer eller andra räntebärande värdepapper utgivna av företag, inklusive kreditinstitut, och andra emittenter såsom kommuner, stater och internationella organisationer m.fl. Vid placering i

derivatinstrument ska underliggande tillgångar utgöras av, eller hänförs till, sådana tillgångar som avses i 5 kap. 12 § första stycket LVF.

Högst 10 procent av fondens värde får placeras i fondandelar.

Fonden får ta upp kortfristiga lån till belopp som maximalt motsvarar 10 procent av fondens värde. Fonden får låna ut överlåtbara värdepapper i en omfattning som motsvarar högst 20 procent av fondens värde.

Den genomsnittliga durationen ska uppgå till högst tio år.

## § 6 Särskild placeringsinriktning

Fonden får placera i sådana överlåtbara värdepapper och penningmarknadsinstrument som avses i 5 kap. 5 § LVF.

Fonden investerar i derivatinstrument som ett led i placeringsinriktningen.

Fondens medel får även investeras i sådana derivatinstrument som anges i 5 kap. 12 § andra stycket LVF (OTC-derivat).

Fonden använder sig av valutaderivat för att valutasäkra sina innehav denominerade i andra valutor än svenska kronor.

Fonden får använda sådana tekniker och instrument som avses i 25 kap. 21 § Finansinspektionens föreskrifter (FFFS 2013:9) om värdepappersfonder i syfte att minska kostnader och risker i Fonden eller i syfte att öka avkastningen och skapa hävstång i Fonden.

## § 7 Marknadsplatser

Fondens medel får placeras på en reglerad marknad eller motsvarande marknad utanför EES samt på annan marknad, inom eller utanför EES, som är reglerad och öppen för allmänheten.

## § 8 Värdering

Fondens värde beräknas genom att det från Fondens tillgångar avdrages de skulder som avser Fonden.

Värdet av en fondandel beräknas normalt varje svensk bankdag av Fondbolaget.

Finansiella instrument som ingår i Fonden värderas med ledning av gällande marknadsvärde. I första hand används marknadskurser. Om sådana kurser inte är tillgängliga eller om kurserna enligt Fondbolagets bedömning är missvisande får finansiella instrument upptas till det värde som Fondbolaget på objektiv grund bestämmer. Vid värdering på objektiv grund fastställs ett marknadsvärde baserat på uppgifter om senast betalt pris eller indikativ köpkurs från market maker om sådan finns utsedd för emittenten. Om dessa uppgifter saknas eller inte bedöms som tillförlitliga fastställs marknadsvärdet med hjälp av information från motparter eller andra externa källor. Likvida medel och kortfristiga fordringar (placeringar på konto i kreditinstitut, korta placeringar på penningmarknaden samt likvider för sålda värdepapper) värderas till det belopp varmed de beräknas inflyta.

För sådana överlåtbara värdepapper som avses i 5 kap. 5 § LVF, för det fall en aktiv marknad saknas, genomförs en särskild värdering där ett marknadsvärde fastställs på objektiva grunder då bland annat följande faktorer kan beaktas:

- ▷ möjligheten att omsätta instrumentet
- ▷ marknadspriser från icke reglerad marknad eller andra oberoende källor
- ▷ anskaffningsvärdet
- ▷ diskonterade kassaflöden
- ▷ kapitalandel av det egna kapitalet (bokslutsvärdering)
- ▷ bolagshändelser med påverkan på marknadsvärdet.

Om marknadspris vid värdering av OTC-derivat inte kan fastställas enligt något av alternativen ovan eller blir uppenbart avvikande, fastställs en värdering på objektiva grunder enligt en så kallad modellvärdering. Vid en sådan värdering används

standardmodeller etablerade utifrån likvärdiga modeller använda av aktiva marknadsaktörer i den typ av OTC-derivatet som värderas. Exempel på standardmodeller är Black & Scholes avseende optioner eller interpolerad nollkupongsvärdering för instrument såsom ränteswappar. Förutom modellvalet så tas också modellernas marknadsparametrar från priser på standardinstrument kvoterade av aktiva marknadsaktörer.

Till Fondens skulder räknas, förutom skulder vilka uppkommit till följd av Fondens verksamhet, framtida skatteskulder och förvaltningsersättning.

Värdet av en fondandel är Fondens värde enligt ovan delat med antalet utestående fondandelar, med beaktande av villkor som är förenade med respektive andelsklass.

## § 9 Teckning och inlösen av andelar

Fonden är normalt öppen för teckning och inlösen av fondandelar varje svensk bankdag.

Anmälan om teckning eller inlösen av fondandel ska för klass C, D och E göras senast 10:00 på ordinarie bankdagar. Övriga klasser ska anmälas senast 14:00 på ordinarie bankdagar.

Begäran om teckning respektive inlösen av fondandelar får återkallas endast om Fondbolaget medger detta.

Teckning och inlösen sker till en för andelsägaren vid begäran om teckning eller inlösen, okänd kurs. Uppgifter om tecknings- och inlösenpris avseende föregående bankdag kan erhållas hos Fondbolaget eller förvaringsinstitutet.

Teckningspris för en fondandel uppgår till fondandelens värde på teckningsdagen beräknat enligt § 8, samt eventuella tillkommande transaktionskostnader i andelsklass C, D och E enligt § 11.

Inlösenpriset för en fondandel uppgår till fondandelens värde på inlösendagen beräknat enligt § 8, samt eventuella tillkommande

transaktionskostnader i andelsklass C, D och E enligt § 11.

Fondandelars värde fastställs och publiceras senast kl. 11:00 ordinarie svensk bankdag på Fondbolagets hemsida. Likvid och leverans av fondandelar respektive Portföljtransaktioner sker enligt normal likvidcykel (två bankdagar) följande anmälan om teckning och inlösen.

För det fall värdet av Fondens förmögenhet överstiger 5 000 000 000 SEK äger styrelsen rätt att besluta om stängning av teckning av fondandelar. Om fondförmögenheten understiger kapitalgränsen efter det att Fonden har stängts, kan möjlighet till teckning åter komma att erbjudas.

Fonden kan stängas för teckning och inlösen av fondandelar om Fonden har så stort innehav av finansiella instrument på en underliggande marknad som är helt eller delvis stängd att Fonden inte kan värderas på ett sätt som säkerställer andelsägarnas lika rätt.

#### § 10 Stängning av teckning och inlösen vid extraordinära förhållanden

Fonden kan komma att stängas för teckning och inlösen om sådana extraordinära förhållanden inträffat som gör att värdering av Fondens tillgångar inte kan göras på ett sätt som säkerställer andelsägarnas lika rätt.

#### § 11 Avgifter och ersättning

Ur Fondens medel får ersättning betalas till Fondbolaget för dess förvaltning, marknadsföring och administration av Fonden. Ersättningen beräknas dagligen på Fondens värde och får högst uppgå till 0,6 per år i andelsklass A, 0,5 procent per år i andelsklass B, 0,25 procent per år i andelsklass C, D och E. Ersättningen inkluderar kostnader för förvaring, tillsyn och revisorer.

Kostnader för courtage, skatt m.m. vid köp respektive försäljning av finansiella instrument ska belasta Fonden.

På ersättningarna enligt ovan tillkommer vid varje tidpunkt gällande mervärdesskatt.

#### Tillkommande transaktionskostnader i andelsklass C, D och E.

Vid teckning tillkommer en teckningsavgift om högst 2 procent av fondandelens värde som ersättning endast till Fonden för Fondens transaktionskostnader i samband med teckningen. Vid inlösen tillkommer inlösenavgift om högst 2 procent av fondandelens värde som ersättning endast till Fonden för Fondens transaktions-kostnader i samband med inlösen.

För teckning och inlösen av fondandelar kan kunden begära att själv bära sina transaktionskostnader. Fondbolaget ska efter begäran om sådant förfarande, senast kl. 12:00 samma dag tillstålla kunden en lista av sådana finansiella instrument ("Portföljtransaktioner") Fonden kommer behöva handla för att täcka sådan teckning eller inlösen i syfte att bibehålla önskad risknivå. Kunden kan välja att vara motpart i en eller flera av sådana Portföljtransaktioner och/eller, för de Portföljtransaktioner Fondbolaget exekverar i marknad till följd av teckning eller inlösen, erlagga/erhålla, för respektive Portföljtransaktion, skillnaden mellan exekveringskurs, inklusive direkta kostnader och värderingen enligt samma principer och kurser som fondandelens pris fastställs. Teckning eller inlösen enligt ovan kan begäras varje ordinarie bankdag.

#### § 12 Utdelning

Utdelning lämnas varje år till fondandelsägare som är registrerad i andelsägarregistret som innehavare av fondandelar av andelsklass E på dag som fastställs av Fondbolaget ("Avstämningsdag"). Utdelning utbetalas i maj och fastställs av Fondbolaget.

Andelsklassen ska ge en årlig utdelning som motsvarar fondens erhållna direktavkastning sedan föregående Avstämningsdag med justering för den utdelande andelsklassens andel av den totala fondförmögenheten.

Utdelningen påverkar relationen mellan värdet på andelar som är icke utdelande och värdet på andelar som är utdelande genom att värdet på de

utdelande fondandelarna minskar i relation till utdelningens storlek.

### § 13 Fondens räkenskapsår

Räkenskapsår för Fonden är kalenderår.

### § 14 Halvårsredogörelse och årsberättelse

Fondbolaget ska lämna en årsberättelse om Fonden inom fyra månader från räkenskapsårets utgång. Årsberättelsen ska tillställas Finansinspektionen och skickas kostnadsfritt till samtliga andelsägare som begärt att få denna samt finnas att tillgå hos Fondbolaget och förvaringsinstitutet.

Fondbolaget ska lämna en halvårsredogörelse om Fonden för räkenskapsårets första sex månader inom två månader från halvårets utgång. Halvårsredogörelsen ska tillställas Finansinspektionen och skickas kostnadsfritt till samtliga andelsägare som begärt att få denna samt finnas att tillgå hos Fondbolaget och förvaringsinstitutet.

### § 15 Ändring av fondbestämmelser

Fondbolagets styrelse beslutar om ändringar i fondbestämmelserna. Efter att Finansinspektionen har godkänt ändringarna ska de ändrade fondbestämmelserna hållas tillgängliga hos Fondbolaget och förvaringsinstitutet, samt i förekommande fall tillkännages på det sätt som Finansinspektionen anvisar.

### § 16 Pantsättning och överlåtelse

Andelsägare kan pantsätta sina andelar i Fonden, såvida inte andelsägaren är ett pensionssparinstitut som placerat pensionsparmedel för pensionssparares räkning eller försäkringsbolag som placerat pensionsparmedel för pensionssparares räkning. Pantsättning sker genom att pantsättaren eller panthavaren skriftligen underrättar Fondbolaget om pantsättningen. Av underrättelsen ska följande framgå:

1. vem som är fondandelsägare/pantsättare,
2. vem som är panthavare,
3. vilka fondandelar som omfattas av pantsättningen, och
4. eventuella begränsningar av pantsättningens omfattning.

Underrättelsen ska undertecknas av pantsättaren.

Önskemål om överlåtelse av fondandel ska skriftligen anmälas till Fondbolaget. Andelsägare ansvarar för att anmälan är behörigen undertecknad. Anmälan om överlåtelse ska ange överlåtare och till vem som andelarna överlåtes, dennes personnummer/organisationsnummer, adress, telefonnummer, vp-konto alternativt depåbank och depånummer, bankkonto samt syftet med överlåtelsen.

Överlåtelse av andel erfordrar att Fondbolaget medger överlåtelsen. Sådant medgivande lämnas av Fondbolaget endast om överlåtelsen sker för att genomföra bodelning av giftorättsgods, avser gåva till make/maka eller egna barn eller avser överlåtelser mellan olika juridiska personer inom samma koncern.

### § 17 Ansvarsbegränsning

Fondbolaget eller förvaringsinstitutet ansvarar inte för skada som beror av svenskt eller utländskt lagbud, svensk eller utländsk myndighetsåtgärd, krigshändelse, strejk, blockad, bojkott, lockout eller annan liknande omständighet. Förbehållet i fråga om strejk, blockad, bojkott och lockout gäller även om Fondbolaget eller förvaringsinstitutet är föremål för eller själv vidtar sådan konfliktåtgärd.

Skada som uppkommit i andra fall skall inte ersättas av Fondbolaget eller förvaringsinstitutet om Fondbolaget respektive förvaringsinstitutet varit normalt aktsamt. Fondbolaget eller förvaringsinstitutet är i intet fall ansvarigt för indirekt skada, om inte den indirekta skadan orsakats av Fondbolagets eller förvaringsinstitutets grova vårdslöshet.

Fondbolaget eller förvaringsinstitutet svarar inte för skada som orsakats av svensk eller utländsk börs eller annan marknadsplats, depåbank, central värdepappersförvarare, clearingorganisation, eller annan som tillhandahåller motsvarande tjänster, och inte heller av uppdragstagare som Fondbolaget eller förvaringsinstitutet med tillbörlig omsorg anlitat eller som anvisats av Fondbolaget. Detsamma

gäller skada som orsakats av att ovan nämnda organisationer eller uppdragstagare blivit insolventa. Fondbolaget eller förvaringsinstitutet ansvarar inte för skada som uppkommer för Fondbolaget, andelsägare i Fonden eller annan i anledning av förfogandeinskränkning som kan komma att tillämpas mot Fondbolaget eller förvaringsinstitutet beträffande värdepapper.

Föreligger hinder för Fondbolaget eller förvaringsinstitutet att helt eller delvis verkställa åtgärd enligt dessa bestämmelser på grund av omständighet som anges i första stycket får åtgärden uppskjutas till dess hindret har upphört. I händelse av uppskjuten betalning skall Fondbolaget eller förvaringsinstitutet inte erlagga dröjsmålsränta.

Om ränta är utfäst, ska Fondbolaget eller förvaringsinstitutet betala ränta efter den räntesats som gällde på förfallodagen.

Är Fondbolaget eller förvaringsinstitutet till följd av omständighet som anges i första stycket förhindrat att ta emot betalning för Fonden, har Fondbolaget eller förvaringsinstitutet för den tid under vilken hindret förelegat rätt till ränta endast enligt de villkor som gällde på förfallodagen.

Oaktat ovanstående har Fondbolaget och förvaringsinstitutet skadeståndsskyldighet enligt 2 kap. 21 § och 3 kap. 14-16 §§ LVF.

### § 18 Inskränkning i teckningsrätt

Fonden eller fondandelarna är inte och avses inte heller bli registrerade i enlighet med vid var tid gällande United States Securities Act 1933 eller United States Investment Companies Act 1940 eller annan tillämplig lagstiftning i USA.

Fondandelar (eller rättigheter till fondandelar) får inte erbjudas, säljas eller på annat sätt distribueras till eller för räkning U.S. Persons (så som detta definieras i Regulation S i United States

Securities Act och tolkas i United States Investment Companies Act 1940).

Fondandelar får inte heller erbjudas, säljas eller på annat sätt distribueras till fysiska eller juridiska personer om detta enligt Fondbolagets bedömning skulle innebära eller medföra risk för;

- ▷ överträdelse av svensk eller utländsk lag eller författning,
- ▷ att Fondbolaget måste vidta särskilda registrerings- eller andra åtgärder eller åsamkas betydande nackdelar ur skattemässigt eller ekonomiskt hänseende och detta skäligen inte kan krävas av Fondbolaget, eller
- ▷ att Fonden åsamkas skada eller kostnader som inte ligger i andelsägarnas intresse.

Den som vill förvärva andelar i Fonden ska till Fondbolaget uppge nationell hemvist. Andelsägare är vidare skyldig att, i förekommande fall, meddela Fondbolaget eventuella förändringar av nationell hemvist.

Köpare av andelar i Fonden ska vidare till Fondbolaget bekräfta att han eller hon inte är en U.S. Person och att fondandelarna förvärfas genom en transaktion utanför USA i enlighet med Regulation S.

Efterföljande överlåtelse av andelarna eller rättigheter till dessa tar endast göras till en non-US person och ska ske genom en transaktion utanför USA som omfattas av undantag enligt Regulation S.

Om Fondbolaget bedömer att det inte har rätt att erbjuda, sälja eller på annat sätt distribuera fondandelar enligt ovan äger Fondbolaget rätt att dels vägra verkställighet av sådant uppdrag om köp av andelar i Fonden, dels, i förekommande fall, utan förtida samtycke lösa in sådan andelsägares innehav av andelar i Fonden för dennes räkning och utbetala sålunda tillkommande medel till denne.

