

BASFAKTA FÖR INVESTERARE

CAPTOR DAHLIA GREEN BOND



Detta faktablad riktar sig till investerare och innehåller basfakta om denna fond. Faktabladet är inte reklammaterial. Det är information som krävs enligt lag för att hjälpa dig att förstå vad en investering i fonden innebär och riskerna med denna. Du rekommenderas att läsa den så att du kan fatta ett välgrundat investeringsbeslut.

Captor Dahlia Green Bond Andelsklass A (ISIN: SE0011337179).

Förvaltare för fonden är Captor Fund Management AB med organisationsnummer 559051-3189.

Mål och placeringsinriktning

Captor Dahlia Green Bond är en aktivt förvaltd obligationsfond som investerar i gröna obligationer samt obligationer med olika hållbarhetsteman. Information om vad som anses som gröna obligationer återfinns i informationsbroschyren. Fondens gör oberoende hållbarhetsbeslut för att säkerställa att obligationen finansierar hållbara projekt. Fondens applicerar även en kontroll för att säkerställa att fondens samtliga tillgångar efterlever internationella normer och konventioner som FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

Fonden investerar utöver gröna obligationer i andra räntetillgångar och derivatinstrument. En obligations riskfaktorer kredit, valuta och ränterisk beaktas separat och kan balanseras till önskad nivå med hjälp av derivat på portföljnivå.

Kreditexponeringen tillåts vara global för att möjliggöra diversifiering. Valuta- och ränterisk är koncentrerad till andelsklassens valuta.

Genom att temporärt investera i säkerställda obligationer i samband med stora inflöden kan vi undvika att köpa gröna obligationer som är dyra för tillfället eller som inte passar in i förvaltningsstrategin. Detta betyder att andelen gröna obligationer kan variera över tiden.

Fonden har som mål att uppnå bästa möjliga avkastning utan att ha en högre genomsnittlig risk än A-rating enligt Morningstar portföljmodell.

Fonden är normalt öppen för teckning och inlösen varje svensk bankdag. Andelsklassen lämnar inte någon utdelning. Rekommendation: Fonden kan vara olämplig för investerare som planerar att ta ut sina pengar inom två år.

Avkastning och riskprofil

Lägre risk Högre risk
←-----→
Lägre möjlig avkastning Högre möjlig avkastning

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 2 | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

Risk/avkastningsindikatorn visar sambandet mellan risk och förväntad avkastning för fonden. En högre placering på skalan betyder möjlighet till högre avkastning, men också större risk att din investering kan minska i värde. Kategori 1 innebär inte att investeringen är riskfri.

Riskkategorin beräknas med data från de senaste fem åren. Eftersom fonden inte har fem års historik har riskindikatorn beräknats utifrån pro forma historik. Tidigare resultat kan vara ett otillförlitligt mått på fondens framtida risk/avkastningsprofil.

Fonden tillhör kategori 3. Det betyder att fonden har låg risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet. Kategorin kan ändras över tiden.

Följande risker återspeglas inte helt i risk/avkastningsindikatorn men påverkar ändå fondens värde:

Fonden placerar i räntebärande värdepapper som generellt kännetecknas av lägre risk än aktiemarknaden. Exponeringen innebär dock kreditrisk mot det emitterande bolaget, alltså den risk att bolaget inte kan återbetala obligationen fullt ut. Fonden hanterar risken genom en diversifiering över emittenter och sektorer.

Fonden är utsatt för motpartsrisk, alltså risken att motparten inte kommer uppfylla sina skyldigheter till fonden. Det kan till exempel 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 säkershshantering.

Teckning och inlösen i fonden kan skapa likviditetsrisk för fonden om vissa instrument är illikvida.

Avgifter

| Engångsavgifter som tas ut före eller efter du investerar | |
|--|--------|
| Insättningsavgift | Ingen |
| Uttagsavgift | Ingen |
| Ovanstående är det maximibelopp som kan tas ut av dina pengar innan de investeras/innan behållningen betalas ut. | |
| Avgifter som tagits ur fonden under året | |
| Årlig avgift | 0,60 % |
| Avgifter som tagits ut ur fonden under särskilda omständigheter | |
| Prestationsbaserad avgift | Ingen |

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.

Den årliga avgiften är ett kostnadsått som inkluderar förvaltningsavgiften och avser kostnader i fonden under kalenderåret 2020.

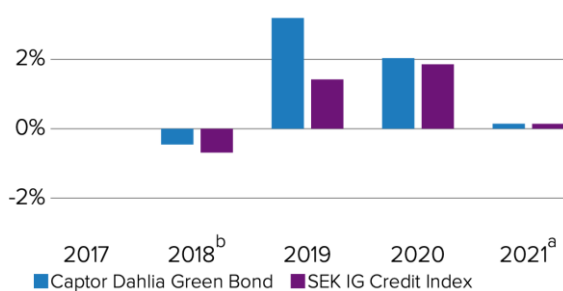
Rörliga transaktionskostnader från värdepapperstransaktioner, räntekostnader, skattekostnader relaterade till transaktioner och om så finns, prestationsbaserad avgift är inte inkluderat under årlig avgift.

Avgiften minskar fondens potentiella avkastning. Avgiften kan variera något från år till år.

Mer information om avgifterna hittar du i fondbestämmelserna på www.captor.se.

Tidigare resultat

ÅRSÅVKASTNING (%)



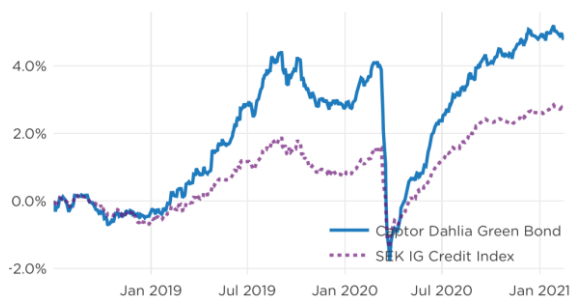
| | 2017 | 2018 ^b | 2019 | 2020 | 2021 ^a |
|--------------------------|------|-------------------|------|------|-------------------|
| Captor Dahlia Green Bond | 0,0% | -0,5% | 3,2% | 2,0% | 0,1% |
| SEK IG Credit Index | 0,0% | -0,7% | 1,4% | 1,9% | 0,1% |
| Diff | 0,0% | 0,2% | 1,8% | 0,1% | 0,0% |

a) Avkastning per 2021-02-03 b) Avkastning sedan fondstart 2018-07-02

I diagrammet visas ett jämförelseindex. Fonden avser inte att följa jämförelseindex.

Fondens resultat beräknas efter avdrag för avgifter och kostnader. Fondens värde beräknas i SEK. Fondens tidigare resultat är ingen garanti för framtida resultat.

VÄRDEUTVECKLING



Praktisk information

Mer information om fonden framgår av informationsbroschyren, fondbestämmelserna, hel- och halvårsrapporten. Dessa går att finna på hemsidan.

Andelsvärdet beräknas dagligen och publiceras på hemsidan. Gällande svensk skattelagstiftning kan komma att inverka på din personliga skattesituation. Minsta första insättning är 100 kronor. Fondbolagets ersättningspolicy finns på hemsidan, en papperskopia erhålls på begäran.

Telefonnummer: +46 8 701 01 00
Förvaringsinstitut: Swedbank AB (publ.)
Hemsida: www.captor.se

Captor Fund Management AB kan hållas ansvarigt endast om ett påstående i detta faktablad är vilseledande, felaktigt eller oförenligt med de relevanta delarna av fondens informationsbroschyr.

Auktorisation: Denna fond är auktoriserad i Sverige och tillsyn över fonden utövas av Finansinspektionen.
Publicering: Dessa basfakta för investerare gäller per den 17 februari 2021.

