

BASFAKTA FÖR INVESTERARE

CAPTOR DAHLIA GREEN BOND



Detta faktablad riktar sig till investerare och innehåller basfakta om denna fond. Faktabladet är inte reklamaterial. 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 C (ISIN: SE0011337195).

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

Mål och placeringsinriktning

Captor Dahlia Green Bond är en aktivt förvaldat obligationsfond som investerar i gröna obligationer samt obligationer med olika hållbarhetsteman. Information om vad som anses som gröna obligationer återfinns i informationsbroschyren. Fonden gör oberoende hållbarhetsbeslut för att säkerställa att obligationen finansierar hållbara projekt. Fonden 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 risk än A-rating enligt Morningstar portföljmodell.

Fonden är normalt öppen för teckning och inlösen varje svensk bankdag. Fonden betalar inte ut några utdelningar. 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 säkerhetshantering.

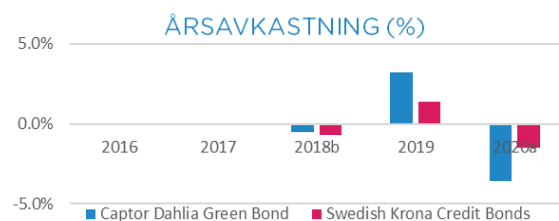
Teckning och inlösen i fonden kan skapa likviditetsrisk för fonden om vissa instrument är illikvida.

Avgifter

Engångsavgifter som tas ut före eller efter du investerar	
Insättningsavgift	0-2%
Uttagsavgift	0-2%
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	0,250 %
Avgifter som tagits ut ur fonden under särskilda omständigheter	
Prestationsbaserad avgift	Ingen

Den årliga avgiften är ett kostnadsmått som inkluderar förvaltningsavgiften och avser kostnader i fonden under kalenderåret 2019. Avgiften minskar

Tidigare resultat



	2016	2017	2018 ^b	2019	2020 ^a
Captor Dahlia Green Bond	0.0%	0.0%	-0.5%	3.2%	-3.6%
Swedish Krona Credit Bonds	0.0%	0.0%	-0.7%	1.4%	-1.5%
Diff	0.0%	0.0%	0.2%	1.8%	-2.1%

a) avkastning per 2020-04-03. b) avkastning sedan fondstart 2018-07-01

Fonden startade den 2 juli 2018.

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

Praktisk information

Mer information om fonden framgår av informationsbroschyren, fondbestämmelserna, hel- och halvårsrapporten. Dessa går att finna på hemsidan. Där finns också detta faktablad översatt till engelska.

Andelsvärdet beräknas dagligen och publiceras på hemsidan. Gällande svensk skattelagstiftning kan komma att inverka på din personliga skattesituation. Minsta första insättning är 10 000 000 kronor. Fondbolagets ersättningspolicy finns på hemsidan, en papperskopia erhålls på begäran.

Auktorisation: Denna fond är auktoriserad i Sverige och tillsyn över fonden utövas av Finansinspektionen.

Publicering: Dessa basfakta för investerare gäller per den 1 oktober 2020

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

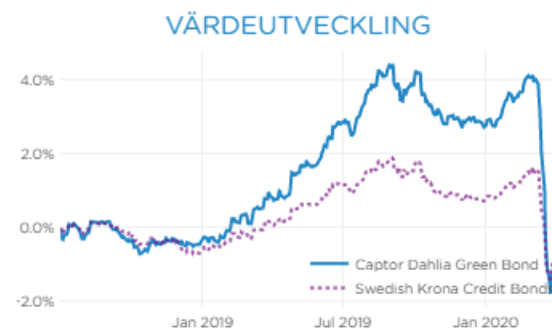
fondens potentiella avkastning. Avgiften kan variera något från år till år. Rörliga transaktionskostnader från värdepapperstransaktioner, räntekostnader, skattekostnader relaterade till transaktioner och om så finns, prestationsbaserad avgift är inte inkluderat under årlig avgift.

I syfte att skydda andelsägare mot effekten av marknadspåverkan vid teckning respektive inlösen kan fonden ta ut en avgift om 2%. Den investerare som väljer att bära sina egna transaktionskostnader och kostnader för marknadspåverkan undviker insättning- och uttagsavgift.

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

Fondens resultat beräknas efter avdrag för avgifter och kostnader.

Fondens värde beräknas i SEK. Fondens tidigare resultat är ingen garanti för framtida resultat.



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.

