



CAPTOR

CAPTOR SCILLA GLOBAL EQUITY

MÅNADSRAPPORT - JUNI 2022



FÖRVALTARKOMMENTAR

Första halvan av månaden har visat på en negativ marknadsutveckling och det har varit en viss återhämtning under andra halvan. Fonden avslutande månaden med en nedgång på -0,7% (klass C) och fondens jämförelseindex -4,5%. Volatiliteten har kommit upp under perioden jämfört med föregående månad.

Det är endast två sektorer bland fondens innehav som haft ett positivt bidrag till månadens avkastning. Dessa sektorer är dagligvaror och hälsovård. Sektorerna står tillsammans för cirka 30% av fondens aktieexponering vilket har gynnat fonden jämfört med jämförelseindex. Grupperat per land så är det en blandad bild. Den amerikanska aktiemarknaden har bidragit mest till månadens avkastning. Den sämsta marknaden, mätt som genomsnittlig utveckling i lokal valuta, har varit den svenska med en nedgång på cirka -5% för fondens innehav. På valutamarknaden har det varit överlag försvagning för svenska kronan. SEK har försvagats mot samtliga valutor förutom NOK och JPY. De största rörelserna mot SEK har varit CHF (+5%) och USD (+5%).

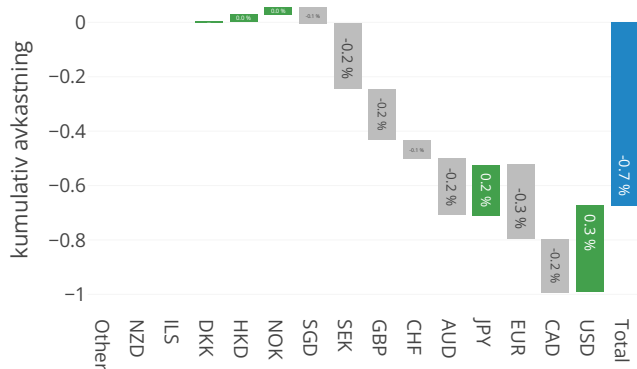
Följande bolag hade de största rörelserna under månaden: Orion (+12%), Nissin Foods (+11%) och Sherwin-Williams (-16%). För närvarande har fonden en aktieexponering på 92%.

PLACERINGSINRIKTNING OCH FÖRVALTNINGSMETODIK

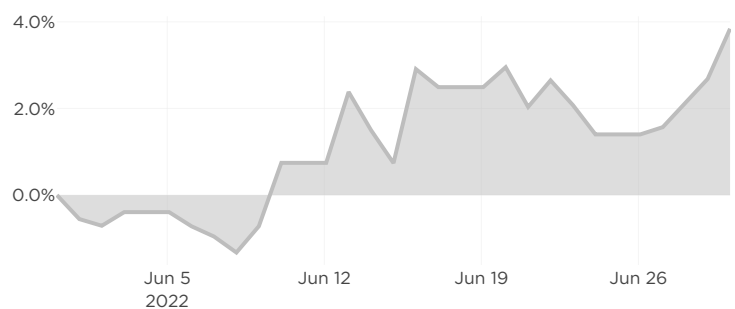
Captor Scilla Global Equity är en aktivt förvaltd fond som placerar globalt i aktier på utvecklade marknader. Fonden bygger på Captors förvaltningsstrategi Scilla. Strategin investerar i bolag som förväntas ha ett bättre förhållande mellan avkastning och risk, jämfört med marknadens genomsnitt. Urvalsmetoden innebär att strategin är investerad i mellan 200 och 300 bolag, vilket är ungefär en femtedel av fondens totala tillåtna urval.

Strategin lägger särskild fokus på riskhantering vilket innebär att fonden kan hålla en relativt stor andel räntetillgångar eller kassa i en stressad marknad, och använda en viss hävstång i lugnare marknader. Fondens strategi är robust och förvaltarna gör löpande endast mindre justeringar i metodiken. Det borgar för bättre riskjusterad avkastning över tid jämfört med aktiefonder som saknar motsvarande fokus på riskhantering.

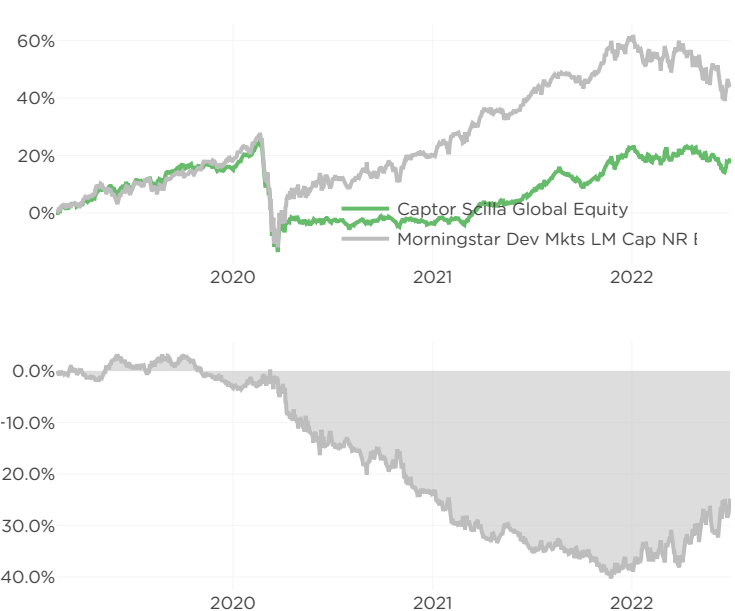
ATTRIBUTION INNEVARANDE MÅNAD



RELATIV AVKASTNING MÅNAD



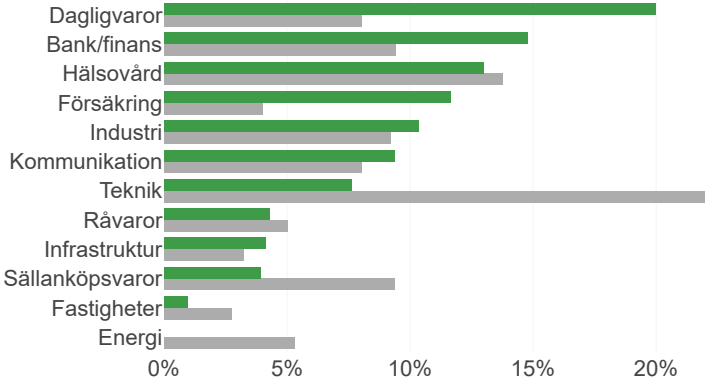
VÄRDEUTVECKLING



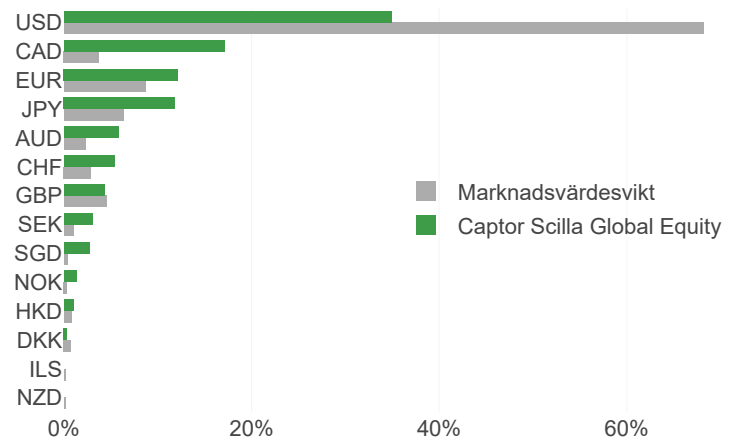
RISIKINFORMATION

Historisk avkastning är ingen garanti för framtida avkastning. De pengar som placeras i fonden kan både öka och minska i värde och det är inte säkert att du får tillbaka hela det insatta kapitalet. Informationen utgör inte investeringsrådgivning och ska inte ses som annat än en redogörelse över fondens handelsaktiviteter och innehav. Faktablad och informationsbroschyr finns på www.captor.se/fonder.

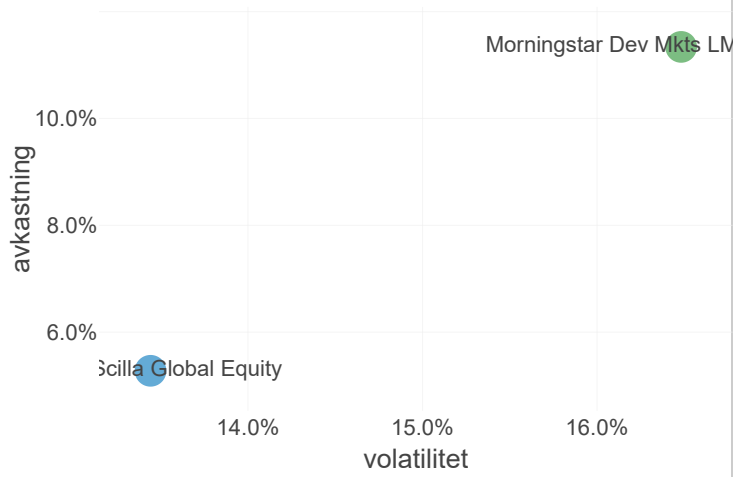
SEKTORALLOKERING



VALUTAALLOKERING

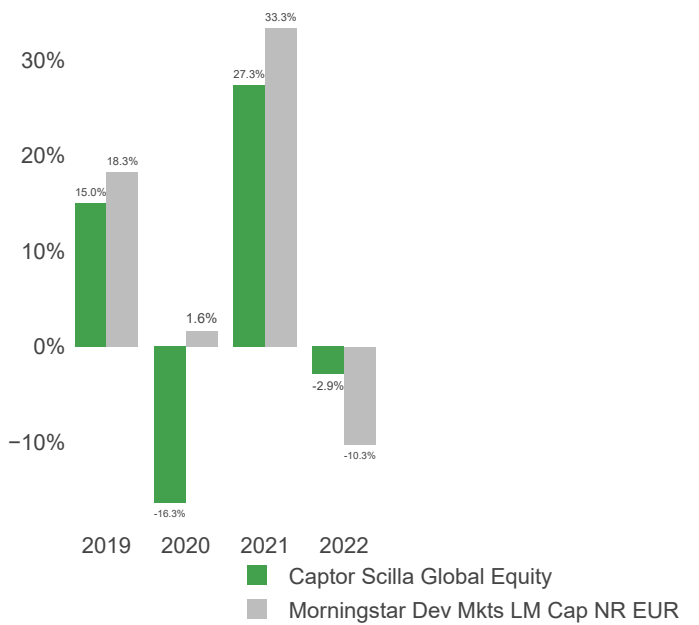


AVKASTNING VS VOLATILITET

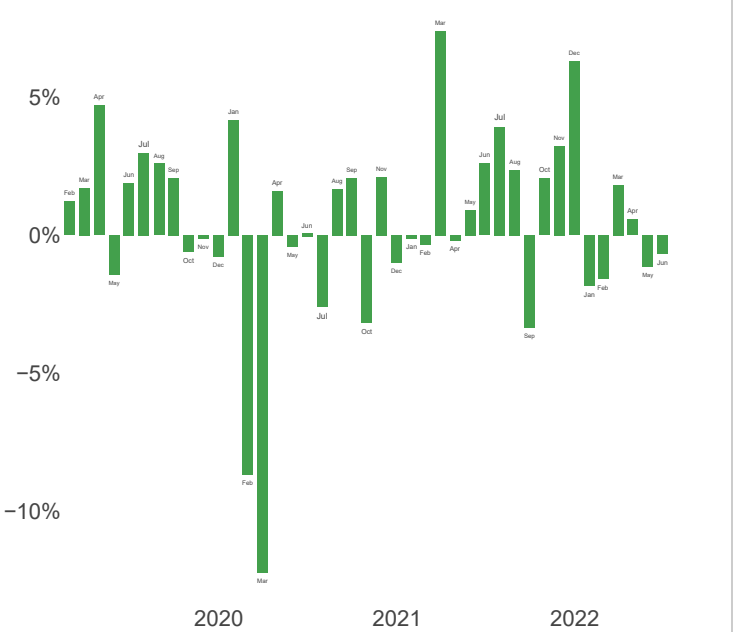


Grafen visar valutaallokering i fonden jämfört med den marknadsvärdesviktade underliggande populationen.

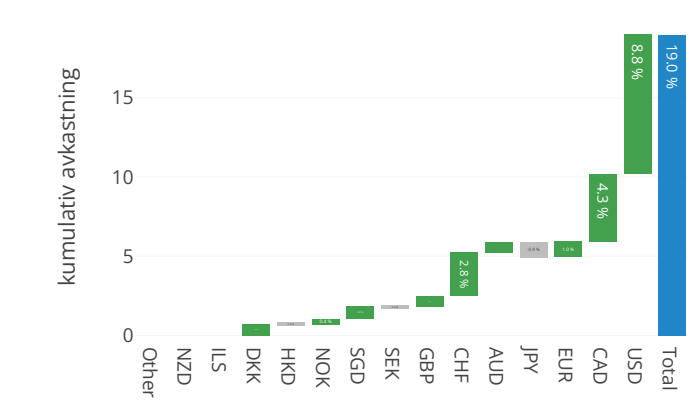
AVKASTNING PER ÅR



AVKASTNING PER MÅNAD



KUMULATIV RESULTATATTRIBUTION



AVKASTNINGSTABELL

	Helår	Jan Feb	Mar Apr	Maj Jun	Jul Aug	Sep Okt	Nov Dec
2022	-2.9%	-1.8% -1.6%	1.8% 0.6%	-1.2% -0.7%			
2021	27.3%	-0.1% -0.3%	7.4% -0.2%	0.9% 2.6%	3.9% 2.4%	-3.3% 2.1%	3.2% 6.3%
2020	-16.3%	4.2% -8.7%	-12.2% 1.6%	-0.4% 0.1%	-2.6% 1.7%	2.1% -3.2%	2.1% -1.0%
2019	15.0%	1.2%	1.7% 4.7%	-1.4% 1.9%	3.0% 2.6%	2.1% -0.6%	-0.1% -0.8%

STÖRSTA INNEHAV

Namn	Andel	Valuta	Sektor
BCE Inc	0,8%	CAD	Kommunikation
Hydro One Ltd	0,8%	CAD	Infrastruktur
Intact Financial Corp	0,7%	CAD	Försäkring
Swisscom AG	0,7%	CHF	Kommunikation
Johnson & Johnson	0,7%	USD	Hälsovård
Royal Bank of Canada	0,7%	CAD	Bank/finans
Procter & Gamble Co/The	0,7%	USD	Dagligvaror
Bristol-Myers Squibb Co	0,7%	USD	Hälsovård
Verizon Communications Inc	0,6%	USD	Kommunikation
Thomson Reuters Corp	0,6%	CAD	Teknik

UTESTÅENDE ANDELSKLASSER

	Klass K	Klass B	Klass C
NAV	346.4300	230.2216	119.0688
Datum för NAV	2022-06-30	2022-06-30	2022-06-30
Utdelande	Nej	Nej	Nej
Kortnamn Bloomberg	SCIGLOK SS Equity	SCIGLOB SS Equity	SCIGLOC SS Equity
ISIN	SE0015193172	SE0010101360	SE0011670843
Handel	Dagligen	Dagligen	Dagligen
Bryttid	14:00	14:00	10:00
SFDR	Artikel 8	Artikel 8	Artikel 8
Minsta investering	100	100	10 000 000
Förvaltningsavgift	0,425%	0,75%	0,375%
Valuta	SEK	SEK	SEK
Fondtyp	UCITS	UCITS	UCITS
Valutasäkrad	Nej	Nej	Nej

VARFÖR INVESTERA I FONDEN?

Captor Scilla Global Equity passar den som vill ha en allokering mot globala aktier och samtidigt ha en jämn och kontrollerad risknivå.

HUR MAN INVESTERAR I FONDEN

Vissa av fondens klasser finns tillgängliga för privatpersoner och institutioner via Nordnet, Avanza, SAVR, Swedbank, Fondo och Alpcot. Du kan också kontakta din bank. De flesta depåinstitut är anslutna till MFEX, FundSettle eller Allfunds och på begäran kan fonderna tillhandahållas även om de inte finns öppet marknadsförda hos respektive institut. Klass C har hög minsta teckning varför den som tecknar eller gör inlösen står för exekveringskostnaden vid genomförandet, i syfte att skydda fondens andelsägare. Förfarandet fungerar enligt samma principer som för börshandlade fonder och möjliggör apport av tillgångar vid teckning och omvänt vid inlösen.

RISKPROFIL

Fonden har som mål att ha en lägre volatilitet än motsvarande marknadsvärdeviktade portfölj över tid. Fondens strategi har även som mål att portföljens värde skall falla mindre än marknaden i stort när stora värdefall sker i följd vid stressade marknadsförhållanden.

Fondens förvaltare



Daniel Karlgren

Daniel har femton års erfarenhet av handel av ränte- aktie- och valutaprodukter. Han har tidigare arbetat som kvantitativ analytiker och kapitalförvaltare på Handelsbanken samt byggt upp och förvaltat en derivatportfölj på Industrivärden.

Kontakt: daniel.karlgrén@captor.se



William Sjöberg

William Sjöberg har en civilingenjörsexamen från KTH i Stockholm med inriktning mot finansiell matematik och en utbildning inom kvantitativ finans från CQF Institute. William har tidigare arbetat på Nordea under åtta år med derivat inom flertalet tillgångsslag.

Kontakt: william.sjöberg@captor.se