



CAPTOR

CAPTOR SCILLA GLOBAL EQUITY

MÅNADSRAPPORT - AUGUSTI 2022



FÖRVALTARKOMMENTAR

Under augusti gick aktiemarknaden först upp kraftigt positiv men föll tillbaka i slutet av månaden. Det positiva momentum som drivit aktiemarknaden i juli och in i augusti tvärvände efter statistik som visar på fortsatt högt pristryck i världen. Fonden avslutade månaden med en uppgång på +0,8% (klass C) och fondens jämförelseindex +0,2%. Volatiliteten har under månaden varit något lägre på aktiemarknaden än månaden innan.

Det har varit en bred nedgång bland fondens sektorexponeringar mätt i lokal valuta. Det är enbart bolag inom råvaror som haft en positiv utveckling. De sämsta sektorerna har varit infrastruktur och hälsovård. Grupperat per land så har bolag i Japan, Singapore och Danmark gått positivt bland fondens innehav. Det har varit stora rörelser på valutamarknaden under månaden. Svenska kronan har försvagats mot samtliga övriga valutor där de största rörelserna har varit USD (-4,6%), HKD (-4,6%) och AUD (-3,7%).

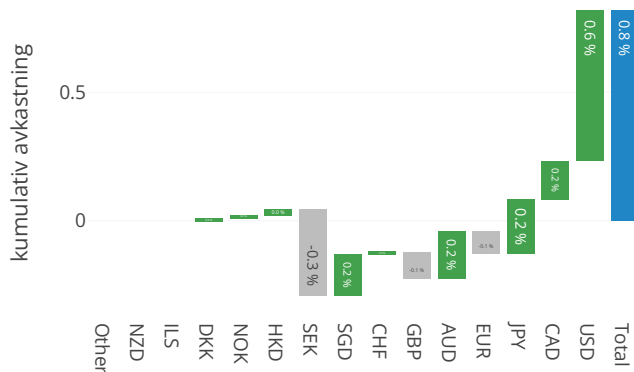
Följande bolag hade de största rörelserna under månaden: Restaurant Brands International (+13%), Trend Micro (+12%) och Open Text (-21%). För närvarande har fonden en aktieexponering på 87%.

PLACERINGSINRIKTNING OCH FÖRVALTNINGSMETODIK

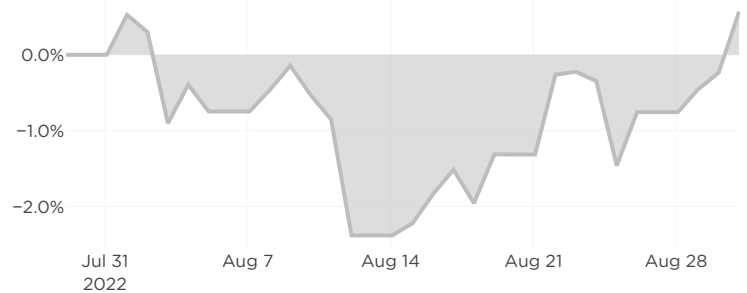
Captor Scilla Global Equity är en aktivt förvaltd fond som placerar globalt i aktier på utvecklade marknader. Fonden bygger på Captors förvaltningsstrategi Scilla. Strategin investerar i bolag som förväntas ha ett bättre förhållande mellan avkastning och risk, jämfört med marknadens genomsnitt. Urvalsmetoden 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 räntetilgångar 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.

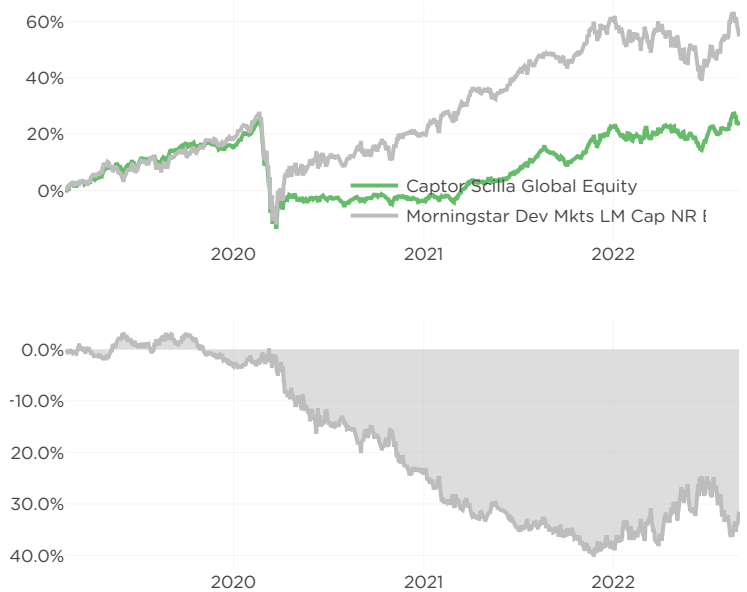
ATTRIBUTION INNEVARANDE MÅNAD



RELATIV AVKASTNING MÅNAD



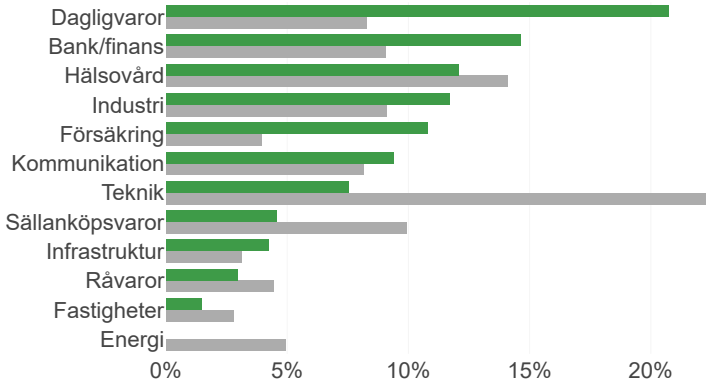
VÄRDEUTVECKLING



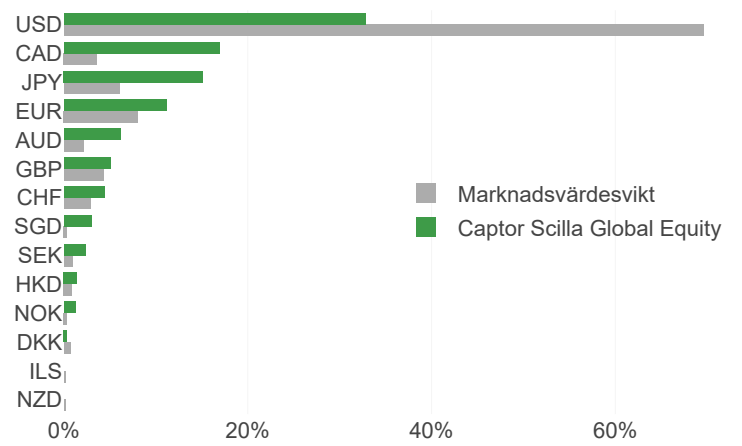
RISIKINFORMATION

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.

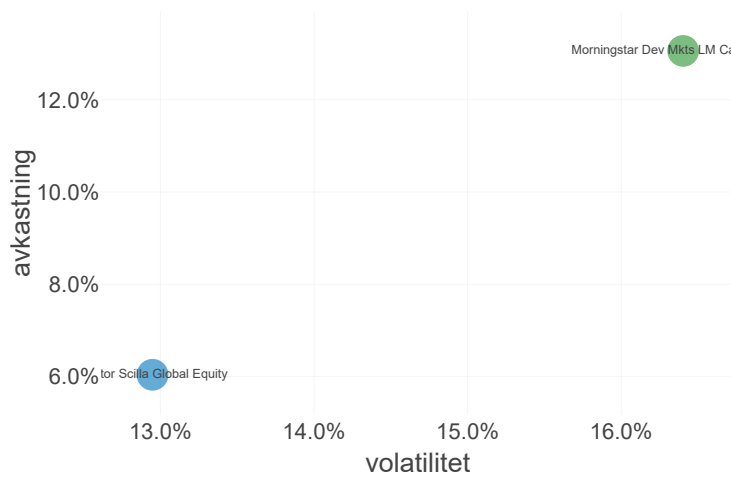
SEKTORALLOKERING



VALUTAALLOKERING

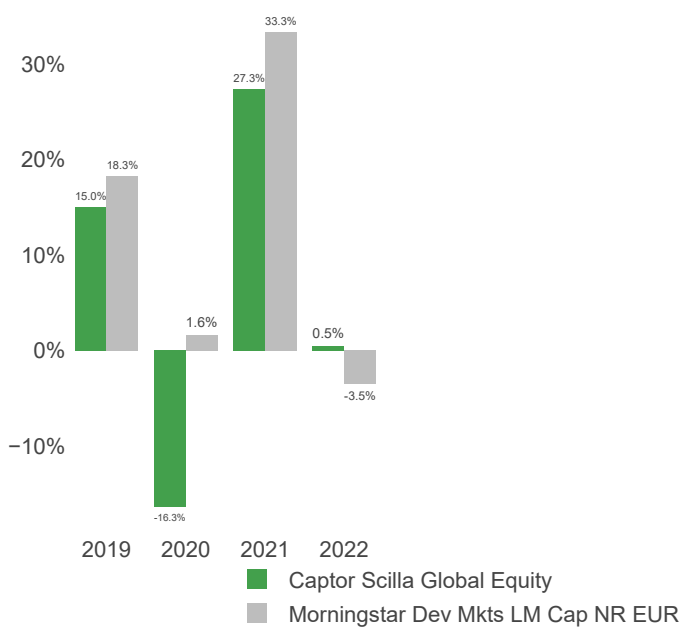


AVKASTNING VS VOLATILITET

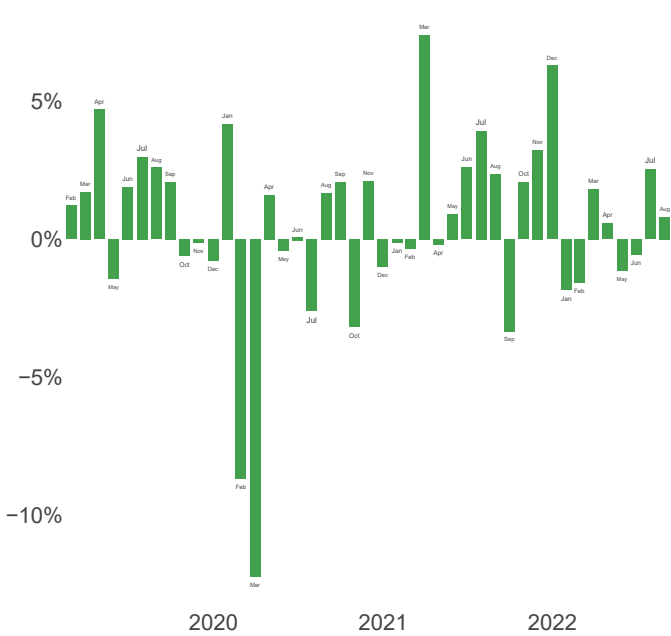


Grafen visar valutaallokering i fonden jämfört med den marknadsvärdesviktade underliggande populationen.

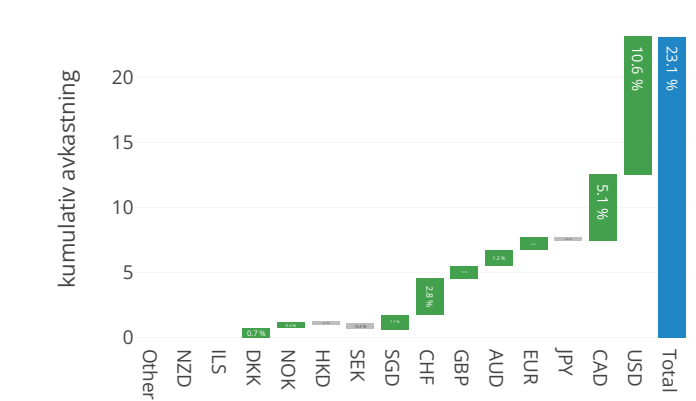
AVKASTNING PER ÅR



AVKASTNING PER MÅNAD



KUMULATIV RESULTATATTRIBUTION



AVKASTNINGSTABELL

| | Helår | Jan Feb | Mar Apr | Maj Jun | Jul Aug | Sep Okt | Nov Dec |
|------|--------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|----------------|
| 2022 | 0.5% | -1.8% -1.6% | 1.8% 0.6% | -1.2% -0.6% | 2.5% 0.8% | | |
| 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 |
|------------------------|-------|--------|-----------------|
| Hydro One Ltd | 0,8% | CAD | Infrastruktur |
| Thomson Reuters Corp | 0,6% | CAD | Teknik |
| Royal Bank of Canada | 0,6% | CAD | Bank/finans |
| DBS Group Holdings Ltd | 0,6% | SGD | Bank/finans |
| Johnson & Johnson | 0,6% | USD | Hälsovård |
| McKesson Corp | 0,6% | USD | Hälsovård |
| Waste Connections Inc | 0,6% | CAD | Industri |
| Bunzl PLC | 0,6% | GBP | Sällanköpsvaror |
| BCE Inc | 0,6% | CAD | Kommunikation |
| Loblaw Cos Ltd | 0,6% | CAD | Dagligvaror |

UTESTÅENDE ANDELSKLASSER

| | Klass K | Klass B | Klass C |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------------------|
| NAV | 358.4918 | 238.1062 | 123.2250 |
| Datum för NAV | 2022-08-31 | 2022-08-31 | 2022-08-31 |
| 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.karlgren@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.sjoberg@captor.se