

Upplysningar som lämnas innan avtal ingås för de finansiella produkter som avses i artikel 8.1, 8.2 och 8.2a i förordning (EU) 2019/2088 och artikel 6 första stycket i förordning (EU) 2020/852 (BILAGA II)

Produktnamn: Captor Aster High Yield **Identifieringskod:** 636700ZS7UIPLCSIGG70

Miljörelaterade och/eller sociala egenskaper

Hållbar investering:

en investering i ekonomisk verksamhet som bidrar till ett miljömål eller socialt mål, förutsatt att investeringen inte orsakar betydande skada för något annat miljömål eller socialt mål och att investeringsobjekten följer praxis för god styrning.

EU taxonomin är ett klassificeringssystem som läggs fram i förordningen (EU) 2020/852, där det fastställs en förteckning över miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Förordningen fastställer inte någon förteckning över socialt hållbara ekonomiska verksamheter. Hållbara investeringar med ett miljömål kan vara förenliga med kraven i taxonomin eller inte.



Hållbarhetsindikatorer mäter uppnåendet av de miljörelaterade eller sociala egenskaperna som den finansiella produkten främjar

Har denna finansiella produkt ett mål för hållbar investering?

Ja

Nej

Den kommer att göra ett minimum av hållbara investeringar med ett miljömål

I ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU taxonomin.

I ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU taxonomin.

Den kommer att göra ett minimum av hållbara investeringar med ett socialt mål

Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper och kommer, även om den inte har hållbar investering som sitt mål, att ha en minimiandel på ___% hållbara investeringar.

med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som anses vara miljömässigt hållbara enligt EU taxonomin.

med ett miljömål i ekonomiska verksamheter som inte anses vara miljömässigt hållbara enligt EU taxonomin.

Den främjar miljörelaterade och sociala egenskaper, men kommer inte att göra några hållbara investeringar.

Vilka miljörelaterade och/eller sociala egenskaper främjas av denna finansiella produkt?

Fonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper genom att integrera miljö-, sociala- och bolagsstyrningsfaktorer vid investeringsbeslut.

Fonden har ingen minimiandel för andel hållbara investeringar men kommer där så bedöms vara möjligt, baserat på de likviditets- och avkastningskrav som gäller för fonden, välja in gröna-, sociala-, eller hållbara obligationer. Genom att fonden strävar efter att, där så möjligt, investera i hållbara obligationer samt de exkluderingskriterier som tillämpas för Fonden, främjas såväl miljömässiga- som sociala egenskaper.

Fonden använder metoden välja bort för att minska hållbarhetsriskerna i fonden. En hållbarhetsrisk innebär miljörelaterade, sociala eller styrningsrelaterade händelser eller förhållanden som, om de skulle förverkligas, skulle kunna ha en negativ inverkan på investeringens värde. Genom att exkludera olika typer av bolag i investeringsbeslutsprocessen minskar hållbarhetsriskerna.

Fonden främjar miljörelaterade egenskaper genom nedan exkluderingar:

Fossila bränslen:

- Olja (max 5% omsättning)
- Kol (max 5% av omsättning)
- Oljesand (max 5% omsättning)
- Naturgas (max 5% omsättning)

Fonden främjar sociala egenskaper genom nedan exkluderingar:

- Kontroversiella vapen (0%)
- Vapen och krigsmaterial (5%)
- Kärnvapen (0%)
- Alkohol (max 5% omsättning)
- Tobak (max 5% omsättning)
- Pornografi (max 5% omsättning)
- Kommersiell spelverksamhet (drift och verksamhet samt skräddarsydd utrustning och tillbehör 5%).

Ett obligationsinnehav medför ingen rättighet till att rösta på bolagsstämman. Captor strävar trots detta att, där det bedöms finnas förutsättningar påverka bolagen i ESG-frågor. Detta sker i sådana fall främst genom dialog och annat engagemang.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållanden mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler. Inför varje investering görs en kontroll så att investeringen lever upp till praxis för god styrning. Detta innebär att investeringen inte får systematiskt bryta mot exempelvis ILO konventionerna.

Huvudsakliga negativa konsekvenser är

investeringsbesluts mest negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer som rör miljö, sociala frågor och personalfrågor, respekt för mänskliga rättigheter samt frågor rörande bekämpning av korruption och mutor.

Fonden främjar investeringar i bolag som efterlever internationella normer och konventioner som FN Global Compact samt OECD:s riktlinjer för multinationella företag.

Fonden exkluderar investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista.

Fonden beaktar hur negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer påverkas enligt artikel 7 (EU) 2019/2088 (Disclosureförordningen) och bolaget kommer att rapportera i enlighet med artikel 11(2) (EU) 2019/2088

Vilka hållbarhetsindikatorer används för att mäta uppnåendet av var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

- Andel av omsättning från fossila bränslen (olja, kol, oljesand, naturgas) (5%)
- Andel av omsättning från kontroversiella vapen (0%)
- Andel av omsättning från vapen och krigsmateriel (5%)
- Andel av omsättning från kärnvapen (0%)
- Andel av omsättning från alkohol (5%)
- Andel av omsättning från tobak (5%)
- Andel av omsättning från pornografi (5%)
- Andel av omsättning från kommersiell spelverksamhet (5%)
- Brott mot internationella normer och konventioner som FN Global Compact och OECD:s riktlinjer för multinationella företag
- Investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista.
- Andel gröna-, sociala- eller hållbara obligationer.
- Andel dialoger och engagemang relaterat till ESG-frågor.

Vilka är målen med de hållbara investeringar som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra, och hur bidrar den hållbara investeringen till dessa mål?

Ej tillämplig då Fonden inte har någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

På vilket sätt orsakar inte de hållbara investeringarna som den finansiella produkten är tänkt att delvis göra någon betydande skada för några miljörelaterade eller sociala mål för hållbar investering?

Ej tillämplig då Fonden inte har någon målsättning att genomföra hållbara investeringar.

● *Hur har indikatorerna för negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer beaktats?*

Fonden beaktar hur negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer påverkas enligt artikel 7 (EU) 2019/2088 (Disclosureförordningen) och bolaget kommer att rapportera i enlighet med artikel 11(2) (EU) 2019/2088. mer information finns i Captors redogörelse för negativa konsekvenser för hållbar utveckling, <https://captor.se/hallbarhet/>

● *Hur är de hållbara investeringarna anpassade till OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter?*

Trots att fonden inte har hållbara investeringar som mål, genomgår samtliga investeringar en screening för att säkerställa att de inte bryter mot internationella normer och konventioner som OECD:s riktlinjer för multinationella företag och FN:s vägledande principer för företag och mänskliga rättigheter, däribland principerna och rättigheterna i de åtta grundläggande konventionerna som anges i internationella arbetsorganisationens (ILO) deklaration om grundläggande principer och rättigheter i arbetslivet och i det internationella regelverket för mänskliga rättigheter.

Captor använder Sustainalytics som extern leverantör av screeningtjänst. Fonden rapporterar hur stor del av fondens innehav som är i linje med ovan nämnda normer och konventioner. Om ett bolag systematiskt bryter mot internationella normer och konventioner kommer detta innehav att säljas av. Fonden rapporterar vilka bolag som sålts av under året i årsrapporteringen.

I EU-taxonomi fastställs en princip om att inte göra betydande skada, enligt vilken taxonomiförenliga investeringar inte får orsaka betydande skada för EU-taxonomins mål, och åtföljs av särskilda EU-kriterier.

Principen om att inte orsaka betydande skada är endast tillämplig på de av den finansiella produktens underliggande investeringar som beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter. Den återstående delen av denna finansiella produkt har underliggande investeringar som inte beaktar EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Inga andra eventuella hållbara investeringar får heller orsaka betydande skada för några miljömål eller sociala mål.



● **Beaktas i denna finansiella produkt negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer?**

Ja

Nej

Klimat och miljörelaterade indikatorer för investeringar i investeringsobjekt:

1. Utsläpp av växthusgaser, Scope 1-3
2. Koldioxidavtryck

3. Investeringsobjektets växthusgasintensitet
4. Exponering mot bolag som är aktiva inom sektorn för fossila bränslen
5. Andel icke-förnybar energikonsumtion och produktion
6. Energikonsumtionsintensitet per sektor med hög klimatpåverkan [som definieras enligt Bilaga I, Regulation (EC) No 1893/2006 of the European Parliament and of the Council]
7. Verksamheter som negativt påverkar områden med känslig biologisk mångfald
8. Utsläpp till vatten
9. Farligt avfall och radioaktivt avfall
15. Avskogning

Sociala indikatorer för investeringar i investeringsobjekt:

2. Olycksfallsfrekvens
10. Brott mot FN:s globala överenskommelse och OECD:s riktlinjer för multinationella företag
11. Inga processer och efterlevnadsmekanismer för att övervaka efterlevnaden av FN:s globala överenskommelse och OECD:s riktlinjer för multinationella företag
12. Ojusterad löneklyfta mellan könen
13. Jämnare könsfördelning i styrelserna
14. Exponering mot kontroversiella vapen (antipersonella minor, klusterammunition, kemiska och biologiska vapen)

Klimat och miljörelaterade indikatorer för investeringar i fastigheter:

17. Exponering mot fossila bränslen genom fastigheter
18. Exponering mot energiineffektiva fastigheter

Sociala indikatorer för investeringar i statliga och överstatliga enheter:

16. Investeringsobjektens hemvist där det förekommer bristande samhällsansvar
17. Andel obligationer som inte utfärdats enligt unionslagstiftningen om miljömässigt hållbara obligationer
20. Genomsnittsvärde för respekten för mänskliga rättigheter.



Investeringsstrategin styr investeringsbeslut på grundval av faktorer som investeringsmål och risktolerans.

Vilken investeringsstrategi följer denna finansiella produkt?

Captor Aster High Yield är en global företagsobligationsfond. Fonden har räntexponering i svenska kronor och en global kreditexponering. I positionstagningen undviks valutarisk och ränterisk i utländska valutor. Därmed minimeras kostnader för valutasäkring och gör att fonden passar institutionella placerare med åtaganden i svenska kronor.

Fonden investerar kapitalet i svenska säkerställda bostadsobligationer i kombination med kreditderivat för att upprätthålla den globala kreditexponeringen, samt räntederivat för positioner i svenska räntor med lång löptid. Fördelen med kreditderivat är att de ger fonden god likviditet och diversifiering. Fonden kan periodvis även investera i företagsobligationer eller obligationer utgivna eller garanterade av stater, kommuner och överstatliga organisationer

Vilka är de bindande delarna i investeringsstrategin som används för att välja de investeringar som uppnår var och en av de miljörelaterade eller sociala egenskaper som främjas av denna finansiella produkt?

- Fonden följer Captors policy för ansvarsfulla investeringar
- Fonden utesluter investeringar i länder som finns med på FN:s och EU:s sanktionslista
- Fonden följer Captors principer för aktieägarengagemang

- Universumet screenas för att exkludera bolag med omsättning inom ett antal produkter och tjänster med identifierade hållbarhetsrisker. Även bolag som systematiskt bryter mot internationella normer och konventioner exkluderas. Innehavet screenas därefter kontinuerligt av fondens förvaltare och bolagets hållbarhetsansvariga. Om ett bolag bryter mot fondens hållbarhetskriterier så kommer det innehavet att säljas av.

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållandet mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler.



● **Vad är policyn för att bedöma praxis för god styrning i investeringsobjekten?**

Praxis för god styrning omfattar sunda förvaltningsstrukturer, förhållanden mellan anställda, personalersättning och efterlevnad av skatteregler. Inför varje investering görs en kontroll så att investeringen lever upp till praxis för god styrning. Detta innebär att investeringen inte får systematiskt bryta mot exempelvis ILO konventionerna.

Captor identifierar verksamheter/stater med aktiviteter som kan anses strida mot internationella konventioner eller omfattas av sanktioner som införts av FN:s säkerhetsråd, det vill säga som inte lever upp till praxis för god styrning. Dessa företag/länder exkluderas från fondens investeringsuniversum. Praxis för god styrning tillämpas inte för statsobligationer i enlighet med EU-regelverket.

Tillgångsallokering beskriver andelen investeringar i specifika tillgångar

Taxonomiförenliga verksamheter uttrycks som en andel av följande:

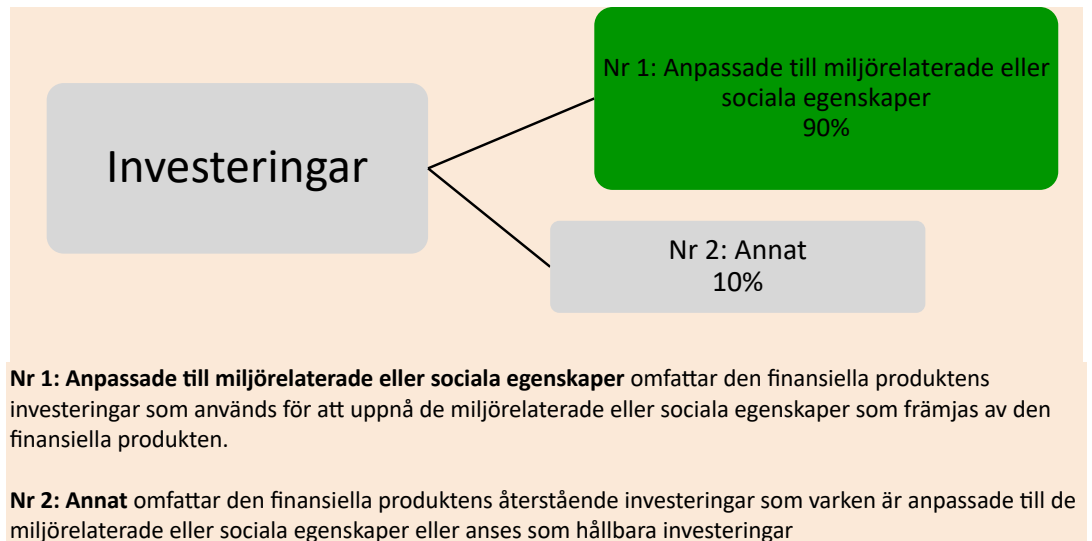
Omsättning: vilket återspeglar andelen av intäkterna från investeringsobjektens gröna verksamheter

Kapitalutgifter: som visar de gröna investeringar som gjorts av investeringsobjekten. Tex för en omställning till grön ekonomi.

Driftsutgifter: som återspeglar investeringsobjektens gröna operativa verksamheter.

● **Vilken tillgångsallokering är planerad för den finansiella produkten?**

Minst 90% av fondens investeringar förväntas vara anpassade till miljörelaterade eller sociala egenskaper.



● **Hur uppnår användningen av derivat de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den finansiella produkten främjar?**

Fonden kan komma att använda derivat, men inte för att upprätthålla fondens hållbarhetskriterier. Captor säkerställer genom intern process att användningen av derivat är i linje med fondens hållbarhetskriterier. Samma kriterier tillämpas vid bedömningen av hållbarhet som vid bedömningen av hållbarhet för värdepapper.

För att uppfylla EU-taxonomin omfattar kriterierna för **fossilgas** begränsningar av utsläpp och övergång till förnybar energi eller koldioxidsnåla bränslen senast i slutet av 2035. När det gäller **kärnenergi** inkluderar kriterierna omfattande säkerhets- och avfallshanteringsregler. **Möjliggörande verksamheter** gör det direkt möjligt för andra verksamheter att bidra väsentligt till ett miljömål. **Omställningsverksamheter** är verksamheter som det ännu inte finns koldioxidsnåla alternativ tillgängliga för och som bland annat har växthusgasutsläpp på nivåer som motsvarar bästa prestanda.

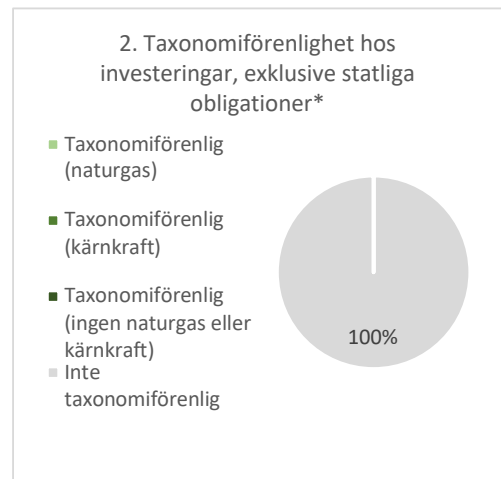
Till vilken lägsta nivå är de hållbara investeringar med ett miljömål förenliga med kraven i EU taxonomin?

Fonden har inget åtagande att göra hållbara investeringar eller hållbara investeringar med ett miljömål förenliga med kraven i EU taxonomin. Inledningsvis sätts därför en miniminivå på 0%.

Investerar den finansiella produkten i fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet som uppfyller EU taxonomin? ¹

- Ja
 I fossil gas I kärnenergi
 Nej

De två diagrammen nedan visar i grönt minimiprocentandelen investeringar som är förenliga med EU-taxonomin. Eftersom det inte finns någon lämplig metodik för att avgöra hur taxonomiförenliga statsobligationer är, visar det första diagrammet taxonomiförenligheten med avseende på den finansiella produktens alla investeringar, inklusive statsobligationer, medan det andra diagrammet visar taxonomiförenligheten endast med avseende på de investeringar för den finansiella produkten som inte är statsobligationer.*



*1

dessa diagram avses med "statsobligationer" samtliga exponeringar i statspapper.

Vilken är minimiandelen investeringar i omställningsverksamheter och möjliggörande verksamheter?

¹ Fossilgas och/eller kärnenergirelaterad verksamhet kommer endast att uppfylla EU-taxonomin om den bidrar till att begränsa klimatförändringarna ("begränsning av klimatförändringarna") och inte orsakar betydande skada för något av målen i EU-taxonomin – se förklarande anmärkning i vänstra marginalen. De fullständiga kriterierna för ekonomisk verksamhet för fossilgas och kärnenergi som uppfyller EU-taxonomin fastställs i kommissionens delegerade förordning (EU) 2022/1214.



Är hållbara investeringar med ett miljömål som **inte beaktar kriterierna** för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter enligt EU-taxonomin.

Ej tillämplig då Fonden inte har något åtagande att göra hållbara investeringar eller hållbara investeringar med ett miljömål förenliga med kraven i EU taxonomin.



Vilken är minimiandelen hållbara investeringar med ett miljömål som inte är förenliga med EU-taxonomin?

Ej tillämplig då Fonden inte har något åtagande att göra hållbara investeringar eller hållbara investeringar med ett miljömål förenliga med kraven i EU taxonomin.



Vilken är minimiandelen socialt hållbara investeringar?

Ej tillämplig då Fonden inte har något åtagande att göra socialt hållbara investeringar.

Referensvärden är index för att mäta om den finansiella produkten uppnår de miljörelaterade eller sociala egenskaper som den främjar.



Vilka investeringar är inkluderade i "Nr 2 Annat", Vad är deras syfte och finns det några miljörelaterade eller sociala minniskyddsåtgärder?

Finns inget åtagande att göra hållbara investeringar. I "Nr 2 Annat" ingår sådana likvida medel som behövs för förvaltning av fonden.



Har ett specifikt index valts som referensvärde för att bestämma om denna finansiella produkt är anpassad till de miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som den främjar?

Inget index har valts i syfte att bestämma om den finansiella produkten är anpassad till miljörelaterade och/eller sociala egenskaper som Fonden främjar.



Var kan jag hitta mer produktspecifik information på nätet?

Mer produktspecifik information finns på webbplatsen:

<https://captor.se/fonder/asterhy>