

Consensus Lighthouse Asset
Halvårsredogörelse
2024



Innehållsförteckning

Förvaltningsberättelse	3
Balansräkning	7
Förklaringar och noter till balansräkning	7
Innehav och positioner i finansiella instrument	8
Uppgifter om värdepappers-finansiering	11
Redovisningsprinciper	11
Värderingsprinciper	11
Allmän information	12

Förvaltningsberättelse

Fonden är en aktivt förvaltd allokeringsfond med nordiskt fokus. Den placerar i instrument med exponering mot tillgångsslagen aktier, räntor och alternativa placeringar. Fonden har som övergripande målsättning att skapa en långsiktig positiv avkastning om 3-5% per år. Fonden skall aktivt utnyttja sitt riskmandat och kommer avvika från underliggande aktiers vikt i index. Det innebär att fonden under tider då aktiemarknaden går starkt inte nödvändigtvis har samma positiva utveckling, men det innebär också att under tider då aktiemarknaden går sämre så finns det en möjlighet att fonden presterar bättre. Fonden har inga begränsningar avseende bransch eller geografisk inriktning utan ska betraktas som en bred fond med nordiskt fokus.

AIF-Förvaltare

Ansvarig AIF-förvaltare för fonden är Wahlstedt & Partners AB. Fondernas portföljförvaltning, marknadsföring, och distribution har uppdragits åt Consensus Asset Management AB (publ), organisationsnummer 556474-6518. Ansvarig portföljförvaltare för fonden är Kristian Witte och Nicklas Bergström.

Kommentar från portföljförvaltarna

Aktieexponeringen har under i princip hela perioden varit neutral (40%). Fonden har under året haft en bas i stabila lågt värderade större bolag, såsom läkemedel, medicinteknik, bank och telekom & IT. Portföljen hade även inslag av opportunistiska bolag som kommit ner kraftigt under föregående år, såsom konsumtion, bygg och bioteknik.

Förutom exponering i en macrofond, består ränteportföljen av en bred kreditexponering via enskilda innehav i företagsobligationer. Vid halvårsskiftet utgjorde denna del av portföljen ca 55 % av AUM. Kreditportföljen är väldiversifierad utan att någon enskild sektor eller emittent är dominerande. Räntedurationen har minskats och ligger på 0,5 år och kreditdurationen är 2,8 år. Den genomsnittliga ratingen

är BB+. Löpande avkastning ligger för närvarande på 5,7 % per år.

Alternativa placeringar

Vid årsskiftet hade fonden ingen exponering mot alternativa placeringar

Fonden stängde halvåret +4,9% (andelsklass A).

5 största innehav per 2024-06-30	% av portföljen
Carlsson Noren Macro Fund	4,30%
Stora Enso OYJ Serie R (SEK)	2,73%
Swedish Orphan Biovitrum AB	2,67%
Essity Aktiebolag-B	2,56%
Swedbank AB A shares	2,46%
Summa	14,7%

Vi förväntar oss att andra halvåret kommer inledas svagt. Osäkerheten kring amerikansk ekonomi och huruvida de står inför en hårdlandning kommer att prägla marknaden. Detta i kombination med en relativt hög värdering på amerikanska aktier, ökar riskerna. Däremot tror vi på en stark aktiemarknad under avslutningen av året. Framförallt gäller detta svensk ekonomi, där vi tror att lägre räntor och en expansiv finanspolitik kommer visa sig i en bättre efterfrågan.

Fonden har för avsikt att inledningsvis ha en försiktig exponering mot aktiemarknaden, där fokus kommer att ligga på värdebolag. Basen (ca 25%) kommer fortfarande att bestå av större bolag. Utöver basen kommer opportunistiska positioner att behållas i mindre bolag (market cap < SEK 10 mdr). Successivt kommer vi att öka aktieandelen, och vi räknar med att ha en övervikt mot slutet av året.

Andelen räntor kommer att vara högre än normalt, då ränteläget fortsatt skapar förutsättningar för god avkastning till en låg risk. Kreditportföljens strategi fortsätter att vara en god spridning mellan branscher tillsammans med något kortare ränteduration då de längre räntorna fallit för mycket och vi tror att marknaden just nu prisar in för stora sänkningar. Kredittidur förväntas vara understigande 3 år. Genomsnittlig rating i kreditportföljen bedöms ligga på BB eller högre.

Alternativa placeringars andel av portföljen väntas vara begränsad då marknadsklimatet kommer att vara för osäkert.

Under året skedde teckningar av fondandelar för 61 131 tkr, inlösen under perioden uppgick till 40 705 tkr. Fondens värde vid årsskiftets slut uppgick till 265 484 tkr.

Väsentliga händelser

Det har inte skett några personella, organisatoriska eller andra förändringar av väsentlig betydelse för fonden under eller efter perioden.

Uppdragsavtal

Wahlstedt & Partners AB har uppdragit åt Nihlmark & Zacharoff Advokatbyrå, med advokat Per Holmgren som funktionsansvarig, att utföra uppdraget som regelefterlevnadsansvarig.

Wahlstedt & Partners AB har uppdragit åt auktoriserad revisor Leif Lüscher, Lüscher & Co Revision AB, att utföra uppdraget som internrevisor.

Wahlstedt & Partners har uppdragit åt Consensus Asset Management, organisationsnummer 556474-6518, portföljförvaltning samt marknadsföring av fonden.

Särskild information om fondens investeringsstrategi

Consensus Lighthouse Asset är en aktivt förvaltd allokationsfond med nordiskt fokus. Den placerar i instrument med exponering mot tillgångsslagen aktier, räntor och alternativa placeringar. Fonden har som övergripande målsättning att skapa en långsiktig positiv avkastning på medellång - lång sikt. Fonden har inga begränsningar avseende bransch eller geografisk inriktning utan ska betraktas som en bred fond med nordiskt fokus.

Fondens risker

Sparande i aktier innebär risk för stora kurssvängningar och därför rekommenderas en spartid överstigande fem år. Risker som kan förväntas förekomma för fonden och därmed dess andelsägare är bland annat marknadsrisk, branschrisk, företagsrisk, ränterisk, inflationsrisk, likviditetsrisk och valutarisk. Fondspararen måste kunna acceptera att stora kurssvängningar kan förekomma.

Följande risker kan bland annat påverka fondens värde:

Motpartsrisk: uppstår om en motpart inte fullgör sina skyldigheter gentemot Fonden, exempelvis genom att inte betala en fastställd summa eller inte leverera ett finansiellt instrument enligt överenskommelse.

Kreditrisk: Risk för förlust på grund av att en motpart eller emittent inte fullgör sina finansiella förpliktelser. Det förekommer när fonder placerar likvida medel hos

kreditinstitut. Vid obligationer och andra räntebärande instrument är kreditrisken främst mot emittenten och dess kreditvärdighet. Vid strukturella produkter är emittentens förmåga att fullgöra sina åtagande enligt villkor av produkten den främsta kreditrisken.

Likviditetsrisk: uppstår om en del av Fondens tillgångar är svåra att sälja vid en viss tidpunkt eller till ett rimligt pris, vilket kan leda till att andelsägare inte kan sätta in och ta ut ur Fonden inom utsatt tid. Fonden strävar efter att ha en lämplig mix av innehav för att även på detta sätt kunna hantera likviditetsrisken på ett effektivt sätt, även under försämrade marknadsförutsättningar. Likviditetsrisk kan dock uppkomma vid extrema marknadsförhållanden eller stora utflöden och kan innebära att andelsägare som löst in fondandelar inte får sin likvid inom skäligen tid.

Marknadsrisk: Den primära risk som är förenad med att placera i aktierelaterade finansiella instrument är marknadsrisk i form av aktiekursrisk, eftersom aktiemarknaderna kan svänga kraftigt i värde vilket kan resultera i en hög volatilitet i fondens värde. På grund av att fonden placerar koncentrerat i en region, har fonden en högre marknadsrisk än en fond som sprider innehaven på flera geografiska marknader.

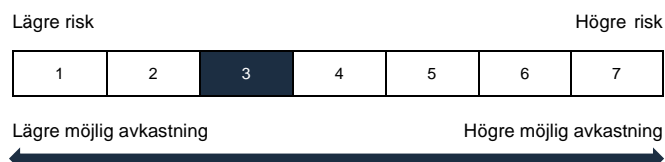
Operativ risk: är risk för förlust på grund av exempelvis systemhaveri, fel orsakade av den mänskliga faktorn eller av externa händelser.

Koncentrationsrisk: är risk som uppstår när en fond tar stora positioner i ett begränsat antal branscher, sektorer, emittenter eller geografiska områden och kan därmed vara mer riskfylld än fonder med ett bredare investeringsuniversum.

Hållbarhetsrisk: miljörelaterad, social eller styrningsrelaterad händelse eller omständighet som, om den förverkligas, skulle kunna ha en betydande negativ inverkan på investeringens värde. Hållbarhetsrisker hanteras genom att hållbarhet integreras i investeringsbesluten.

Riskbedömning

Riskindikatorn är en standardmetod för att visa vilken risknivå som föreligger i en värdepappersfond. Risknivån definieras som VaR-ekvivalent volatilitet och beräknas på data under de senaste fem åren. Inplaceringen på indikatorn är inte konstant och kategoriseringen kan ändras med tiden. Om nämnda statistik saknas kan annan representativ data användas.



Consensus Lighthouse Asset riskläge är 3 på indikatorn vilket motsvarar en VaR-ekvivalent volatilitet på mellan 5 och 12 procent, vilket motsvarar en låg till medel riskklass. Fonden har låg till medel risk för upp- och nedgångar i andelsvärdet.

Utöver risknivån på riskindikatorn eftersträvar förvaltaren att fondens genomsnittliga risknivå mätt som årlig standardavvikelse över en rullande 12-månadersperiod ska ligga mellan 5-15 procent.

Den eftersträvade risknivån skall inte tas för en utfästelse av förvaltaren och fonden kan avvika från risknivån. Det bör särskilt uppmärksammas att den eftersträvade genomsnittliga risknivån kan komma att överskridas vid ovanliga marknadsförhållanden eller extraordinära händelser.

Derivatinstrument

Fonden har enligt fondbestämmelserna möjlighet att använda derivatinstrument för att skapa avkastning eller hävstång i fonden. Fonden får även använda sig av OTC-derivat enligt 5 kap. 12 § andra stycket lagen (2004:46) om värdepappersfonder. Under 2023 har fonden inte nyttjat möjligheten att investera i derivatinstrument.

Fondens kostnader

Fast avgift uppgår till 1,00% för andelsklass A och C, och 0,80% för andelsklass B och D (ej ännu startad) per år av värdet på tillgångarna i fonden.

Ur fondens andelsklasser A och C utgår även en prestationsbaserad avgift som beräknas kollektivt och tas ur fonden månadsvis om högst 20 procent av den positiva avkastningen i respektive andelsklass. Den resultatbaserade ersättningen beräknas efter avdrag för den fasta ersättningen. Ersättningen erlägges månadsvis i efterskott den sista kalenderdagen i månaden och beräknas utifrån 20 procent av den positiva avkastningen vid varje NAV beräkning. I det fall en andelsklass erhållit negativ avkastning under tidigare månader skall resultatbaserad ersättning utgå först efter det att tidigare månaders negativa avkastning kompenseras med motsvarande positiva avkastning under efterföljande månader. Detta gäller på kollektiv nivå vilket gör att alla andelsägare behandlas lika oavsett tidpunkt för investering.

Fonden tar ej ut någon avgift vid teckning samt inlösen av andelar ur fonden.

Hållbarhetsinformation

Fonden integrerar hållbarhetsrisker i investeringsbeslut, utan att fonden främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper eller har hållbara investeringar som mål.

Hantering av hållbarhetsrisker är en integrerad del av portföljförvaltarens investeringsanalys och process,

men är inte bindande för investeringsbesluten och begränsar därmed inte förvaltarens investeringsuniversum. Portföljförvaltaren identifierar hållbarhetsrisker genom att tillämpa analys av bolag som ingår i fondens portfölj samt av nya potentiella investeringar. Hållbarhetsrisker begränsas i viss utsträckning genom att fonden exkluderar vissa branscher och sektorer som portföljförvaltaren bedömer har hög exponering mot hållbarhetsrisker, men är inte bindande för investeringsbeslut. Identifierade hållbarhetsrisker i fonden är bl.a. omställnings-risker och klimatrisker. Fondens främsta hållbarhetsrisker är knutna till bl.a. utsläpp av växthusgaser, energiförbrukning, exponering för fossila bränslen, avfallshantering och innevarande omställningsrisk till en klimatneutral ekonomi med ökade kostnader. Ytterligare risker bedömer portföljförvaltaren vara kopplat till sociala faktorer kopplade till t.ex. arbetsvillkor, brott mot internationella normer och bolagsstyrning.

Integrering av hållbarhetsrisker i investeringsbesluten anser förvaltaren ha en trolig positiv inverkan på fondens avkastning då investeringarna analyseras utifrån en långsiktig hållbarhet. Hållbarhetsrisker följs regelbundet upp genom en utvärdering av de bolag fonden äger.

Transparens i fråga om negativa konsekvenser för hållbar utveckling

Portföljförvaltarna beaktar inte investeringsbesluts negativa konsekvenser för hållbarhetsfaktorer, med anledning av att fonden inte främjar miljörelaterade eller sociala egenskaper eller har hållbara investeringar som mål.

Information om EU:s taxonomi för miljömässigt hållbara verksamheter

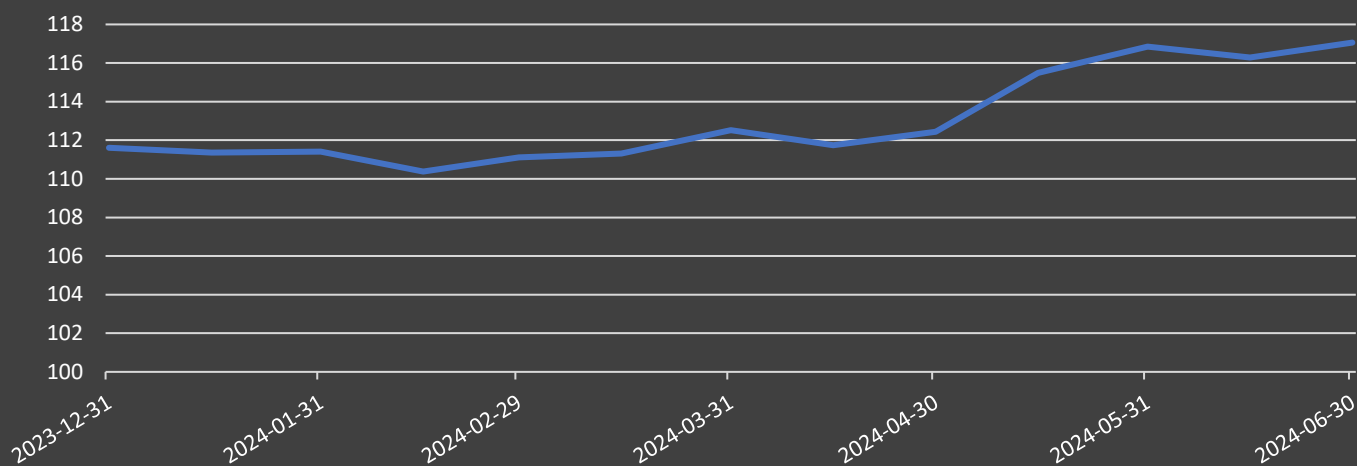
EU-taxonomin är ett klassifikationssystem som syftar till att etablera gemensamma kriterier för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Denna fonds underliggande investeringar beaktar inte EU-kriterierna för miljömässigt hållbara ekonomiska verksamheter.

Förändring av fondförmögenhet

Belopp i tkr	2024-01-01	2023-01-01
	2024-06-30	2023-12-31
Fondförmögenheten vid periodens början	231 928	242 164
Andelsutgivning	61 131	32 010
Andelsinlösen	-40 705	-66 249
Lämnad utdelning	0	0
Resultat enligt resultaträkning	13 129	24 004
Fondförmögenheten vid periodens slut	265 484	231 928

Utveckling andelsvärde 2024



Avkastning för andelsklass A

Utveckling

	2024-01-01 2024-06-30	2023-01-01 2023-12-31	2022-01-01 2022-12-31	2021-01-01 2021-12-31	2020-01-01 2020-12-31	2019-01-01 2019-12-31	2018-01-01 2018-12-31	2017-01-01 2017-12-31	2016-01-01 2016-12-31
Fondförmögenhet, tkr									
- Andelsklass A	91 866	89 527	97 371	133 723	151 455	102 994	133 081	85 572	15 322
- Andelsklass B	173 618	140 187	144 793	153 616	160 614	186 403	213 154	204 088	173 284
- Andelsklass C	-	-	-	-	-	20	684	23	-
Antal utelöpande fondandelar									
- Andelsklass A	784 781	802 180	965 316	1 211 031	1 349 556	949 474	1 327 179	798 681	150 180
- Andelsklass B	1 411 992	1 201 048	1 375 359	1 335 531	1 387 009	1 678 029	2 079 581	1 871 607	1 695 785
- Andelsklass C	-	-	-	-	-	190	7 008	0	-
Andelsvärde, kr									
- Andelsklass A	117,06	111,60	100,87	110,42	112,23	108,47	100,27	106,14	102,02
- Andelsklass B	122,96	116,72	105,28	115,02	115,80	111,08	102,50	108,04	102,18
- Andelsklass C	-	-	-	109,34	104	102,88	98	105,9	-
Fondens totalavkastning									
- Andelsklass A	4,89%	10,62%	-8,65%	-1,61%	3,46%	8,17%	-5,53%	4,04%	2,02%
- Andelsklass B	5,35%	10,84%	-8,47%	-0,67%	4,25%	8,37%	-5,13%	5,74%	2,18%
- Andelsklass C	-	-	-	4,78%	1,43%	5,47%	-7,89%	1,49%	-

Balansräkning

Belopp i tkr	Not	2024-06-30	2023-12-31
TILLGÅNGAR			
Överlåtbara värdepapper	1	248 160	211 755
Fondandelar	1	11 416	11 343
Summa finansiella instrument med positivt marknadsvärde		259 576	223 099
Summa placeringar med positivt marknadsvärde		259 576	223 099
Bankmedel och övriga likvida medel		10 712	6 738
Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter	2	211	49
Övriga tillgångar	3	0	2 042
SUMMA TILLGÅNGAR		270 499	231 928
SKULDER			
Summa finansiella instrument med negativt marknadsvärde		0	0
Upplupna kostnader och förutbetalda intäkter		0	0
Övriga skulder	4	-5 015	0
SUMMA SKULDER		-5 015	0
FONDFÖRMÖGENHET		265 484	231 928
Poster inom linjen			
Utlånade finansiella instrument		19 800	17 270
Mottagna säkerheter för utlånade finansiella instrument		20 790	18 061

Förklaringar och noter till balansräkning

Not 1. Innehav i finansiella instrument

Se nästa sida för specifikation av finansiella instrument.

Not 2. Förutbetalda kostnader och upplupna intäkter

	2024-01-01	2023-01-01
	2024-06-30	2023-12-31
Förutbetald kostnad	11	0
Upplupen ränteintäkt	178	2
Upplupen intäkt aktielån	22	47
Summa	211	49

Not 3. Övriga tillgångar

	2024-01-01	2023-01-01
	2024-06-30	2023-12-31
Fondlikvidfordran	0	2 042
Summa övriga tillgångar	0	2 042

Not 4. Övriga skulder

	2024-01-01	2023-01-01
	2024-06-30	2023-12-31
Fondlikvidskuld	-5 015	0
Summa	-5 015	0

Innehav och positioner i finansiella instrument

Fondens innehav per 2024-06-30	Volym	Marknadsvärde (SEK)	% av portfölj
FINANSIELLA INSTRUMENT MED POSITIVT MARKNADSVÄRDE			
Överlåtbara värdepapper som är upptagna till handel på en reglerad marknad eller en motsvarande marknad utanför EES			
Dagligvaror			
Beyond Meat INC	4 500	320 013	0,12%
Essity Aktiebolag-B	25 000	6 785 000	2,56%
		7 105 013	2,68%
Finans			
Aker Horizons AS	206 000	575 097	0,22%
Svenska Handelsbanken AB (a)	47 000	4 744 650	1,79%
Swedbank AB A shares	30 000	6 543 000	2,46%
		11 862 747	4,47%
Hälsovård			
Addlife AB (b)	35 000	4 396 000	1,66%
Ambea AB	55 000	4 312 000	1,62%
Babylon Holdings LTD- CL A	13 399	14	0,00%
Egetis Therapeutics AB	200 000	934 000	0,35%
Swedish Orphan Biovitrum AB	24 999	7 089 716	2,67%
		16 731 731	6,30%
Industri			
Epiroc AB (a)	30 000	6 345 000	2,39%
Instalco AB	60 000	2 433 600	0,92%
Nibe Industrier AB (b)	70 000	3 145 800	1,18%
Securitas AB (b)	60 000	6 312 000	2,38%
		18 236 400	6,87%
Informationsteknik			
Ericsson (b)	90 000	5 922 000	2,23%
Sinch AB	200 000	5 140 000	1,94%
		11 062 000	4,17%
Material			
Stora Enso OYJ Serie R (SEK)	50 000	7 240 000	2,73%
		7 240 000	2,73%
Sällanköpsvaror och tjänster			
Bygghemma Group First AB	200 000	3 302 000	1,24%
Mekonomen AB	25 000	2 965 000	1,12%
		6 267 000	2,36%
Telekomoperatörer			
Tele2 AB (b)	50 000	5 335 000	2,01%
Viaplay Group AB (b)	470 000	337 178	0,13%
		5 672 178	2,14%
Fixed income			
AKHNO Float 08/15/25	3 000 000	3 038 772	1,14%
ANDHED Float 07/06/26	3 750 000	3 907 153	1,47%
BILLN Float 10/01/25	6 000 000	6 106 657	2,30%
COORSS Float 02/21/27	2 500 000	2 550 186	0,96%
DIOSSS Float 03/14/25	3 750 000	3 809 280	1,43%
DNBNO Float PERP	6 000 000	6 153 836	2,32%
DSNOSS Float 12/16/24	3 750 000	2 097 485	0,79%
ESKILS Float 04/14/25	4 000 000	4 071 957	1,53%
EUFLOB Float 02/02/26	2 500 000	1 900 948	0,72%
FASTIG Float 05/19/28	6 000 000	6 198 499	2,33%

GOLDCP Float 07/11/28	2 500 000	2 500 000	0,94%
HEXAG Float 09/17/25	4 000 000	4 043 483	1,52%
ICASS Float 09/18/28	4 000 000	4 078 272	1,54%
LANHYP Float PERP 270216	4 000 000	4 079 025	1,54%
LFBANK Float 290123 Perp	4 000 000	4 152 599	1,56%
NORENT Float 06/26/25	2 120 000	1 883 261	0,71%
NYSVFI Float 02/21/26	4 000 000	4 052 093	1,53%
PEABSS Float 06/24/27	3 750 000	3 756 421	1,41%
PLAZB Float 11/01/24	4 000 000	4 036 112	1,52%
SAABAB Float 11/20/28	4 000 000	4 127 736	1,55%
SAMPFH Float 06/17/51	4 000 000	3 996 011	1,51%
SASSS Float PERP	4 000 000	391 308	0,15%
SBAB Float PERP	6 000 000	6 203 860	2,34%
SDIPTE Float 08/31/27	1 250 000	1 318 303	0,50%
SINCH Float 11/27/24	3 750 000	3 772 022	1,42%
SKANEB Float 03/27/29	6 000 000	6 069 753	2,29%
SOBISS Float 05/17/27	3 750 000	3 785 893	1,43%
SPAALI Float 02/02/26	4 000 000	4 061 504	1,53%
STEFBS Float PERP	1 250 000	1 276 998	0,48%
STENAM Float 05/10/28	3 750 000	3 850 703	1,45%
TIGO Float 01/20/27	5 000 000	5 143 402	1,94%
TOMNO Float 04/03/29	3 000 000	3 029 268	1,14%
Ellevio AB 2,875%	4 000 000	4 002 043	1,51%
Husqvarna AB 4,718% 11/23/27	4 000 000	4 240 116	1,60%
LANSBK 4,905 03/01/33	2 000 000	2 077 488	0,78%
SEB 5,625% 331103	4 000 000	4 384 805	1,65%
SVEASK 4.147 10/13/25	2 000 000	2 073 110	0,78%
Sparbanken Sjuhärad 4,29% 250328	4 000 000	4 053 973	1,53%
Stockholm Exergi Holding 3,093% 260518	2 000 000	1 995 577	0,75%
TELBSS 3,25% 05/19/27	5 000 000	4 996 457	1,88%
		147 266 370	55,47%
SUMMA ÖVERLÅTBARA VÄRDEPAPPER SOM ÄR UPPTAGNA TILL HANDEL PÅ EN REGLERAD MARKNAD ELLER EN MOTSVARANDE MARKNAD UTANFÖR EES		231 443 439	87,18%
Överlåtbara värdepapper som är föremål för regelbunden handel vid någon annan marknad som är reglerad och öppen för allmänheten.			
Hälsovård			
Eevia Health Abp	450 000	303 300	0,11%
Integrum AB	25 000	1 370 000	0,52%
Nanoform Finland Plc	50 000	938 000	0,35%
Nightingale Health Oyj	65 806	1 718 910	0,65%
		4 330 210	1,63%
Informationsteknologi			
Smart Eye AB	35 000	3 619 000	1,36%
Sällanköpsvaror och tjänster			
Desenio Group AB	600 000	168 000	0,06%
Kjell Group AB (publ)	90 000	1 759 500	0,66%
		1 927 500	0,73%
SUMMA ÖVERLÅTBARA VÄRDEPAPPER SOM ÄR UPPTAGNA TILL HANDEL PÅ EN REGLERAD MARKNAD ELLER EN MOTSVARANDE MARKNAD UTANFÖR EES		9 876 710	3,72%
Andra överlåtbara värdepapper			
Energi			
Azelio AB	302 500	-	0,00%
Hälsovård			
Doktorse Nordic AB	160 000	1 840 000	0,69%

Energi			
Occlutech Holding AG	140 845	4 999 998	1,88%
SUMMA ANDRA ÖVERLÅTBARA VÄRDEPAPPER		6 839 998	2,58%
Övriga finansiella instrument som är föremål för regelbunden handel vid någon annan marknad som är reglerad och öppen för allmänheten			
Fondandelar			
Carlsson Noren Macro Fund	85 104	11 415 795	4,30%
SUMMA FINANSIELLA INSTRUMENT MED POSITIVT MARKNADSVÄRDE		259 575 942	97,77%
Övriga tillgångar och skulder		5 907 842	2,23%
Summa övriga tillgångar och övriga skulder		5 907 842	2,23%
FONDFÖRMÖGENHET		265 483 783	100,00%

Uppgifter om värdepappersfinansiering

Samlade uppgifter gällande värdepappersutlåning

Utlåning av värdepapper

Marknadsvärde	Andel av fondförmögenheten
-19 799 593	7,61%

Mottagna säkerheter för utlåning av värdepapper

Motparter	Marknadsvärde	Typ av säkerhet
Skandinaviska Enskilda Banken	20 789 607	Equities

Uppgifter om koncentration

De tio främsta motparterna per typ av transaktion för värdepappersfinansiering.

Institut	Belopp
SEB	20 789 607

Redovisningsprinciper

Halvårsredogörelsen har upprättats enligt lagen (2013:561) om förvaltare av alternativa investeringsfonder, Finansinspektionens föreskrifter (2013:10) om förvaltare av alternativa investeringsfonder och Fondbolagens Förenings riktlinjer för redovisning av nyckeltal. I övrigt tillämpas bokföringslagens bestämmelser i tillämpliga delar.

Denna halvårsredogörelse är inte granskad av fondens revisor.

Värderingsprinciper

De finansiella instrument som ingår i fonden värderas enligt Consensus Lighthouse Assets fondbestämmelser 8 § daterade 2023-02-01: Fondens värde beräknas genom att från fondens tillgångar dra av de skulder som avser fonden. Fondens tillgångar värderas till gällande marknadsvärde. Marknadsvärde för noterade innehav värderas utifrån gällande marknadsvärde, varmed avses senaste betalkurs eller, om sådan saknas, genomsnittet av köpkurs och säljkurs. Om balansdagen inte är en handelsdag gäller motsvarande för senaste handelsdag före balansdagen. Om pris inte kan erhållas, eller är missvisande enligt fondbolagets bedömning, får värdering ske på objektiv grund enligt allmänt vedertagna värderingsprinciper.

Allmän information

Fondbolaget

Wahlstedt & Partners AB
Box 7029
103 86 STOCKHOLM

Tel: 08-56 260 200
Organisationsnummer: 556771-1345
Hemsida: www.ws.se

Aktiekapital

Fondbolagets aktiekapital är 1 100 000 kronor.

Styrelse och företagsledning

Fondbolagets styrelse och företagsledning består av:

Namn	Titel
Lars Zacharoff	Styrelseordförande
Malin Houlès	Verkställande direktör
Bengt Wahlstedt	Styrelseledamot
Anders Karlsson	Styrelseledamot
Claes Bahri	Styrelseledamot
Linnéa Wahlstedt	Styrelseledamot
Linnea Askestad	Vice verkställande direktör

Ansvariga portföljförvaltare

Kristian Witte och Nicklas Bergström, Consensus Asset Management AB (publ).

Förvaringsinstitut

Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ).

Revisor

Nilla Rocknö
Grant Thornton Sweden AB
103 94 STOCKHOLM

Underskrift

Stockholm, datum enligt elektronisk signatur

Malin Houlès
Verkställande direktör