

Capital Four Invest European Senior Loan A

Categoria Morningstar™

Category_EUCA001028

Benchmark Morningstar

Morningstar European Leveraged Loan TR

EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Credit Suisse WstEur Lev Loan TR Hdg EUR

Morningstar Rating™

Senza rating

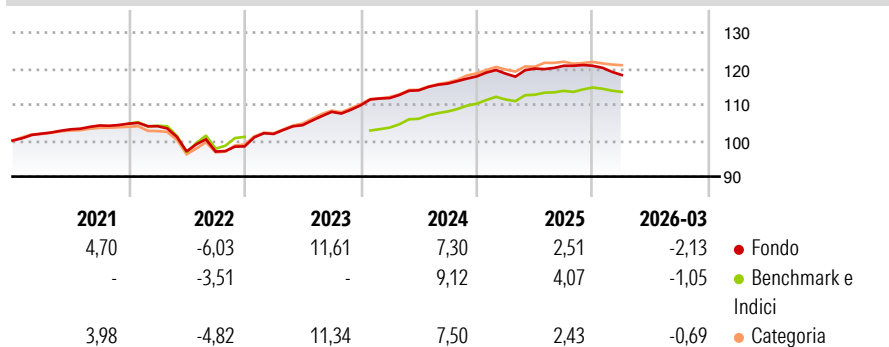
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund C's Investment Policy is based on credit markets. Credit markets offer attractive investment opportunities based on a cyclical perspective (high spreads) and based on systemic factors: - Increased risk awareness; - Reduced activity from traditional buyers of credit assets; and - Continuing high supply from refinancing activities. The Sub-Fund C's investment strategy is based on detailed fundamental analysis and careful portfolio construction and risk management. Structured Products: The Sub-Fund C may invest a maximum of 20% of its Invested Assets in asset backed securities (ABS's), including collateralised loan obligations (CLO's), collateralised mortgage obligations (CMO's), collateralised debt obligations (CDO's) and...

Misure di Rischio

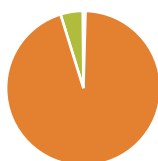
3Y Alpha	-1,71	3Y Sharpe Ratio	0,94
3Y Beta	0,95	3Y Std Dev	2,30
3Y R-Squared	88,15	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-2,64	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	0,76	10Y Risk	-

Basati su Morningstar European Leveraged Loan TR EUR (dove applicabile)

Rendimenti


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,77	-0,65	0,32	2026	-2,13	-	-	-
6-Mesi	-1,44	0,97	-1,38	2025	0,64	1,19	0,66	0,00
1-Anno	1,97	3,77	-0,77	2024	1,82	1,92	1,65	1,71
3-Anni Ann.ti	5,12	7,11	7,31	2023	3,50	2,40	3,55	1,69
5-Anni Ann.ti	3,07	4,98	6,86	2022	-0,67	-6,74	-0,03	1,48
10-Anni Ann.ti	3,24	4,34	-					

Rendimenti aggiornati al 09/04/2026

Portafoglio 31/12/2025


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,43
● Obbligazioni	94,77
● Liquidità	4,66
● Altro	0,13

Fixed Income Style
Box™

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Duration Effettiva			
Maturità effettiva			
Qualità Credito Media			

 Bassa Med Alta
Sensibilità ai Tassi

Fondo
Credit Quality %
Fond
Credit Quality %
Fond

Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Titoli principali

Nome	Settore	%
MASSM TL B 1L EUR	—	1,82
APEGRP TL B 1L EUR	—	1,05
ZENTIV TL B 1L EUR	—	1,05
AVSGRO TL B 1L EUR	—	1,05
RECIB TL B 1L EUR	—	1,00
CGDFP TL B4 1L EUR	—	1,00
INDVET TL B 1L USD	—	0,97
VDXGRO TL B 1L EUR	—	0,95
EURMED TL B2 1L EUR	—	0,95
UNSEAM TL B 1L EUR	—	0,93
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		10,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		2
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		214

Fixed Income Sector Weightings %
Fondo

🏛️ Governativo	0,00
🏢 Societario	95,22
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏛️ Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	9,16
📄 Derivati	-4,37

Coupon Range %
Fondo

0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %
Fondo

da 1 a 3	21,87
da 3 a 5	30,44
da 5 a 7	47,34
da 7 a 10	0,00
da 10 a 15	0,00
da 15 a 20	0,00
da 20 a 30	0,00
oltre 30	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	Capital Four AIFM A/S	Patrimonio Classe (Mln)	606,75 EUR	Investimento Min. Ingresso	50.000 EUR
Telefono	+45 3225 6100	(09/04/2026)		Investimento Min. Successivo	125.000 EUR
Web	www.capital-four.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Data di Partenza	28/11/2014	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	-
Nome del Gestore	-	UCITS	No	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	28/11/2014	Inc/Acc	Acc		
NAV (09/04/2026)	EUR 143,74	ISIN	LU1121114414		
Patrimonio Netto (Mln)	754,71 EUR				

(31/12/2025)