

Luxembourg Life Fund II FCP-RAIF Absolute Return Fund II D2 USD Inc

|                        |                                     |                      |                     |
|------------------------|-------------------------------------|----------------------|---------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar               | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Altro                  | Not Categorized<br>Usato nel Report | N/A                  | Senza rating        |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment policy of the fund is to principally invest in a diversified portfolio of US-domiciled life insurance policies and on an ancillary basis in other mortality related products (such as but not limited to annuities, structured products with derivatives) insuring individuals of an advanced age (generally above the age of 65 years). Such policies are widely known as Life Settlements. Life Settlements offer a known, pay-out structure total return upon the death of the life insured. The fund will purchase Life Settlements, or portfolios of Life Settlements, in the secondary and tertiary markets at a discount to their known, final maturity values. A well-structured and properly diversified portfolio of Life Settlements can provide...

Rendimenti

100

|  | 2020 | 2021  | 2022 | 2023  | 2024 | 2025-09 |
|--|------|-------|------|-------|------|---------|
|  | -    | 13,57 | 8,22 | -2,90 | 7,14 | -14,27  |

Fondo

|                          |                         |                                     |                   |                      |           |           |           |
|--------------------------|-------------------------|-------------------------------------|-------------------|----------------------|-----------|-----------|-----------|
| <b>Misure di Rischio</b> | <b>Rend. Cumulati %</b> | <b>Fondo</b>                        | <b>Rendimenti</b> | <b>Q1</b>            | <b>Q2</b> | <b>Q3</b> | <b>Q4</b> |
| 3Y Alpha                 | - 3Y Sharpe Ratio       | 3-Mesi                              | -0,53             | <b>Trimestrali %</b> |           |           |           |
| 3Y Beta                  | - 3Y Std Dev            | 6-Mesi                              | -9,30             | 2026                 | -         | -         | -         |
| 3Y R-Squared             | - 3Y Risk               | 1-Anno                              | -6,07             | 2025                 | -5,48     | -8,81     | -0,53     |
| 3Y Info Ratio            | - 5Y Risk               | 3-Anni Ann.ti                       | -6,37             | 2024                 | 2,72      | 0,30      | -5,08     |
| 3Y Tracking Error        | - 10Y Risk              | 5-Anni Ann.ti                       | 1,09              | 2023                 | -1,39     | -0,58     | 3,12      |
|                          |                         | 10-Anni Ann.ti                      | -                 | 2022                 | 2,58      | 7,16      | 6,98      |
|                          |                         | Rendimenti aggiornati al 30/09/2025 |                   |                      |           |           |           |

Portafoglio -

Asset Allocation %

Netta

Fixed Income Style

Box™

Alto

Med

Basso

Qualità Credito

Bassa

Med

Alta

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva

Maturity effettiva

Qualità Credito Media

Fondo

Americhe

Europa

Asia

<25

25-50

50-75

>75

Titoli principali

Nome

Settore

%

% Primi 10 Titoli sul Patrimonio

0,00

Numero Complessivo di Titoli Azionari

-

Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari

-

Fixed Income Sector Weightings %

Fondo

Governativo

0,00

Societario

0,00

Cartolarizzazioni

0,00

Enti Locali

0,00

Liquidità ed equivalenti

0,00

Derivati

0,00

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

Ripartizione Geografica %

Fondo

America

0,00

Stati Uniti

-

Canada

-

America Latina e Centrale

-

Europa

0,00

Regno Unito

-

Europa Occidentale - Euro

-

Europa Occidentale - Non Euro

-

Europa dell'Est

-

Africa

-

Medio Oriente

-

Asia

0,00

Giappone

-

Australasia

-

Asia - Paesi Sviluppati

-

Asia - Emergente

-

|                      |                             |                         |              |                              |               |
|----------------------|-----------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|---------------|
| <b>Anagrafica</b>    |                             |                         |              |                              |               |
| Società di Gestione  | Carlisle Management Company | Patrimonio Classe (Mln) | 37,78 USD    | Investimento Min. Ingresso   | 1.000.000 USD |
|                      |                             | (30/09/2025)            |              | Investimento Min. Successivo | -             |
| Telefono             | -                           | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | -             |
| Web                  | -                           | Valuta del Fondo        | USD          | Spese correnti               | -             |
| Data di Partenza     | 30/04/2020                  | UCITS                   | No           | Commissione di incentivo     | -             |
| Nome del Gestore     | -                           | Inc/Acc                 | Inc          |                              |               |
| Data Inizio Gestione | 30/06/2020                  | ISIN                    | LU2095302019 |                              |               |
| NAV (30/09/2025)     | USD 106,35                  |                         |              |                              |               |

# Luxembourg Life Fund II FCP-RAIF Absolute Return Fund II D2 USD Inc

Patrimonio Netto (Mln) -