

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

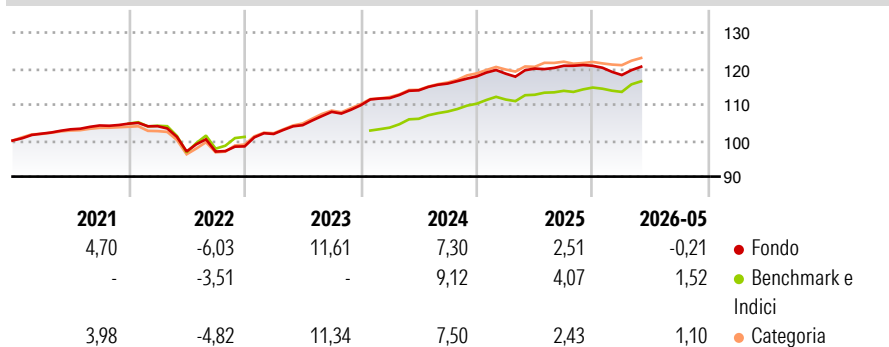
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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

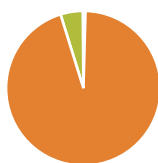
| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | -1,60 | 3Y Sharpe Ratio | 0,94 |
| 3Y Beta | 0,93 | 3Y Std Dev | 2,29 |
| 3Y R-Squared | 86,64 | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | -2,42 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 0,82 | 10Y Risk | - |

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

Rendimenti


| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|-----|--------------------------|-------|-------|-------|------|
| 3-Mesi | 1,63 | 2,97 | - | 2026 | -2,13 | - | - | - |
| 6-Mesi | -0,58 | 1,95 | - | 2025 | 0,64 | 1,19 | 0,66 | 0,00 |
| 1-Anno | 0,68 | 3,65 | - | 2024 | 1,82 | 1,92 | 1,65 | 1,71 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,00 | 6,91 | - | 2023 | 3,50 | 2,40 | 3,55 | 1,69 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,25 | 5,25 | - | 2022 | -0,67 | -6,74 | -0,03 | 1,48 |
| 10-Anni Ann.ti | - | 4,46 | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 22/06/2026

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

-

0

0

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) | 527,31 EUR | Investimento Min. Ingresso | 50.000 EUR |
| Telefono | +45 3225 6100 | (22/06/2026) | | 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 (22/06/2026) | EUR 146,43 | ISIN | LU1121114414 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 754,71 EUR | | | | |

(31/12/2025)

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotte; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.