

# 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

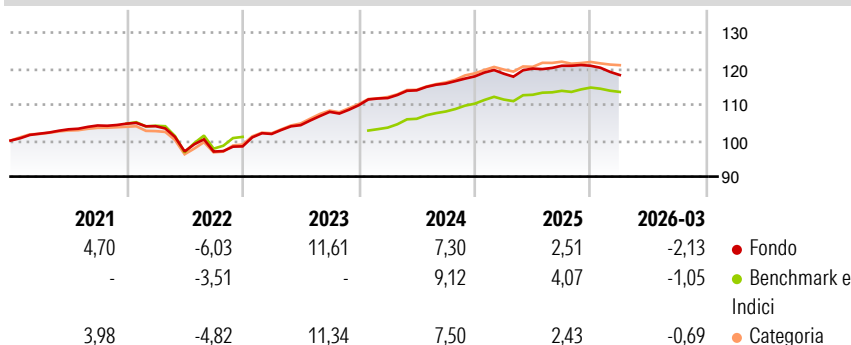
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

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**

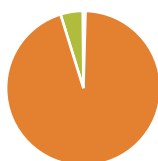
|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | -1,71 | 3Y Sharpe Ratio | 0,94 |
| 3Y Beta           | 0,95  | 3Y Std Dev      | 2,30 |
| 3Y R-Squared      | 88,15 | 3Y Risk         | -    |
| 3Y Info Ratio     | -2,64 | 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           | -0,53 | 0,87 | -   | 2026                     | -2,13 | -     | -     | -    |
| 6-Mesi           | -0,84 | 1,90 | -   | 2025                     | 0,64  | 1,19  | 0,66  | 0,00 |
| 1-Anno           | 1,51  | 4,20 | -   | 2024                     | 1,82  | 1,92  | 1,65  | 1,71 |
| 3-Anni Ann.ti    | 5,19  | 7,25 | -   | 2023                     | 3,50  | 2,40  | 3,55  | 1,69 |
| 5-Anni Ann.ti    | 3,22  | 5,18 | -   | 2022                     | -0,67 | -6,74 | -0,03 | 1,48 |
| 10-Anni Ann.ti   | 3,23  | 4,34 | -   |                          |       |       |       |      |

Rendimenti aggiornati al 29/04/2026

**Portafoglio 31/12/2025**


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

**Fixed Income Style**
**Box™**

| Quantità 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

**o**
**o**
**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        |
| <b>Coupon Range %</b>      | <b>Fondo</b> |
| 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) | 610,85 EUR   | Investimento Min. Ingresso   | 50.000 EUR  |
| Telefono               | +45 3225 6100         | (29/04/2026)            |              | 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 (29/04/2026)       | EUR 145,01            | ISIN                    | LU1121114414 |                              |             |
| Patrimonio Netto (Mln) | 754,71 EUR            |                         |              |                              |             |

(31/12/2025)