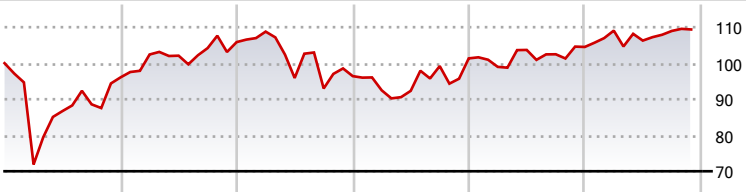
# Capital Four Invest European Senior Loan E

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari Altro | Not Categorized<br>Usato nel Report | Credit Suisse WstEur Lev Loan TR Hdg EUR | 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...

## Rendimenti




| 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025-11 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| -3,93 | 10,19 | -8,92 | 5,10 | 3,14 | 4,64 | ● Fondo |

## Misure di Rischio

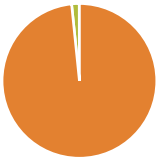
| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,10 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 8,88 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo |
|---|---|
| 3-Mesi | 0,33 |
| 6-Mesi | -0,29 |
| 1-Anno | 4,68 |
| 3-Anni Ann.ti | 4,29 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,95 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 09/12/2025

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2025 | 4,34 | -2,54 | 2,51 | - |
| 2024 | -2,32 | 4,75 | -1,16 | 1,98 |
| 2023 | -4,10 | -0,16 | 7,46 | 2,15 |
| 2022 | 2,75 | -11,84 | -3,05 | 3,71 |
| 2021 | 6,61 | -0,32 | 2,06 | 1,60 |

## Portafoglio 30/06/2025



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 98,37 |
| Liquidità | 1,58 |
| Altro | 0,04 |

**Fixed Income Style Box™**

| | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | - |
| Maturity effettiva | - |
| Qualità Credito Media | |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|

### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| MASORANGE FINCO 03/31 TL | — | 1,74 |
| ROAR BIDCO AB 03/28 TL | — | 1,31 |
| FLORA FOOD MGMT 01/28 TL | — | 1,14 |
| HOUSE OF HR GRO 11/29 TL | — | 1,09 |
| VDK Groep BV FRN TL 01/32 | — | 1,07 |
| APEX GROUP TREA 02/32 TL | — | 1,07 |
| Swissport FRN TL 31/03/31 | — | 1,06 |
| AutoScout24 FNR TL 10/31 | — | 1,05 |
| PAX HOLDCO SPAI 12/30 TL | — | 1,01 |
| ATLAS LUXCO 4 S 05/28 TL | — | 0,99 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 11,52 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 207 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 98,36 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 6,57 |
| Derivati | -4,93 |

| 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 | 19,37 |
| da 3 a 5 | 41,76 |
| da 5 a 7 | 38,43 |
| da 7 a 10 | 0,42 |
| 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 |
| Telefono | +45 3225 6100 |
| Web | www.capital-four.com |
| Data di Partenza | 03/10/2016 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | 28/11/2014 |
| NAV (09/12/2025) | NOK 151,34 |
| Patrimonio Netto (Mln) (30/06/2025) | 774,88 EUR |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) (09/12/2025) | 93,34 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | NOK |
| UCITS | No |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU1499703715 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | 50.000 NOK |
| Investimento Min. Successivo | 125.000 NOK |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | - |
| Commissione di incentivo | - |

© 2025 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 prodotto; (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.