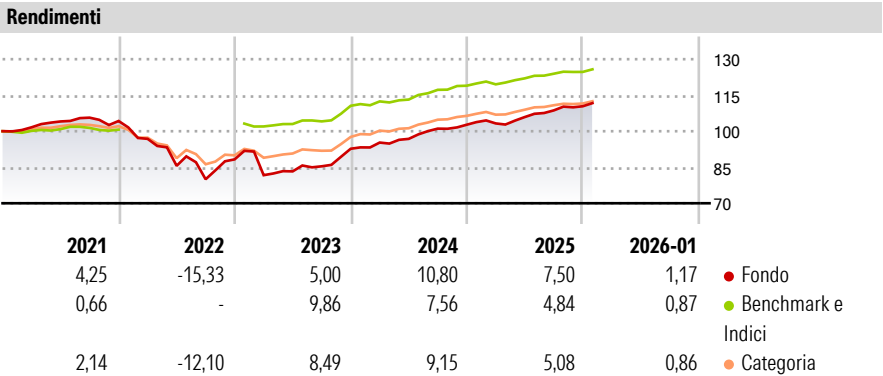


BlueBay Funds - BlueBay Financial Capital Bond Fund R - EUR (AIDiv)

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA000922	Markit iBoxx EUR Corp Subordinated TR Usato nel Report	No benchmark	★★

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

Il fondo si prefigge di conseguire per voi un rendimento combinando la generazione di reddito con la crescita del capitale da voi investito inizialmente e investe prevalentemente in obbligazioni emesse da istituti finanziari che distribuiscono un interesse fisso o variabile. Il fondo mira a conseguire rendimenti migliori di quelli del suo indice di riferimento, che è il BofA Merrill Lynch Contingent Capital Index USD Hedged. L'investimento del fondo può allontanarsi in misura considerevole da tale indice, laddove giustificato dalle condizioni di mercato. Almeno la metà degli investimenti del fondo sarà effettuata in titoli di debito bancari subordinati, che distribuiscono un reddito relativamente elevato e che hanno spesso ottenuto un...



**Misure di Rischio**

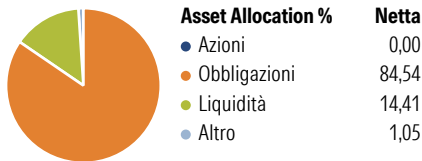
3Y Alpha	-1,26	3Y Sharpe Ratio	0,50
3Y Beta	1,39	3Y Std Dev	7,77
3Y R-Squared	26,99	3Y Risk	Alto
3Y Info Ratio	-0,01	5Y Risk	Alto
3Y Tracking Error	6,70	10Y Risk	-

Basati su Markit iBoxx EUR Corp Subordinated TR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,77	1,18	1,33	2026	-	-	-	-
6-Mesi	3,78	2,45	2,49	2025	0,53	2,57	2,61	1,60
1-Anno	7,49	4,98	5,31	2024	2,79	1,61	4,40	1,61
3-Anni Ann.ti	6,48	6,80	7,11	2023	-7,46	1,93	2,54	8,56
5-Anni Ann.ti	1,86	1,73	2,13	2022	-7,12	-11,61	-6,53	10,35
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 31/10/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Duration Effettiva	-		0		0
Maturity effettiva	5,39				
Qualità Credito Media	BB				
		AAA	0,00	BBB	38,20
		AA	0,00	BB	58,18
		A	0,00	B	3,08
				Below B	0,00
				Not Rated	0,54

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
Deutsche Bank...	—	5,99
Erste Group Bank AG 6.375%	—	4,66
Societe Generale S.A. 10%	—	4,09
Intesa Sanpaolo S.p.A. 9.125%	—	4,01
Barclays PLC 9.25%	—	3,78
Virgin Money UK PLC 11%	—	3,59
Barclays PLC 8.375%	—	3,57
Banco Santander, S.A. 9.625%	—	3,35
Credit Agricole S.A. 6.5%	—	3,25
Bnp 6 11/35 Perp Regs	—	2,97
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		39,25
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		59

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Scadenze %	Fondo
Governativo	0,00	da 1 a 3	12,27
Societario	96,00	da 3 a 5	29,23
Cartolarizzazioni	0,00	da 5 a 7	38,06
Enti Locali	0,00	da 7 a 10	17,21
Liquidità ed equivalenti	-59,61	da 10 a 15	3,09
Derivati	63,61	da 15 a 20	0,00
		da 20 a 30	0,00
		oltre 30	0,00
Coupon Range %	Fondo		
0 coupon	0,00		
Da 0 a 4 cedole	0,00		
Da 4 a 6 cedole	9,34		
Da 6 a 8 cedole	50,93		
Da 8 a 10 cedole	33,42		
Da 10 a 12 cedole	3,74		
Oltre 12 cedole	2,57		

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	0,25 EUR	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	(11/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,50%
Data di Partenza	04/01/2017	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,50%
Nome del Gestore	James Macdonald	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
	Marc Stacey	Inc/Acc	Inc		
Data Inizio Gestione	14/01/2015	ISIN	LU1163203638		
NAV (11/02/2026)	EUR 98,38				
Patrimonio Netto (Mln)	2.645,63 USD				

(31/10/2025)