

BlueBay Funds - BlueBay Financial Capital Bond Fund R - EUR

Categoria Morningstar™

Category_EUCA000922

Benchmark Morningstar

Markit iBoxx EUR Corp Subordinated TR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

No benchmark

Morningstar Rating™

★★

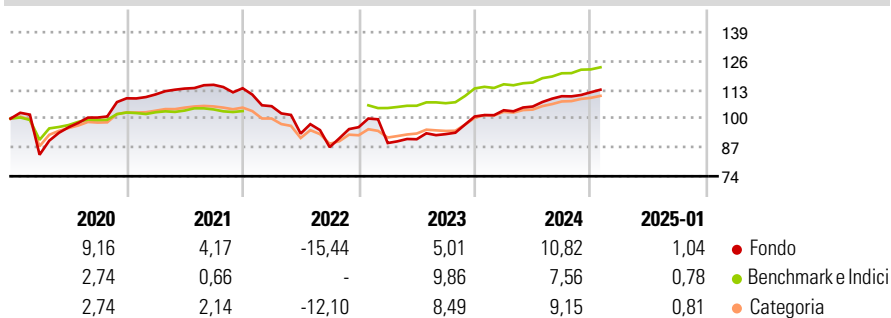
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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

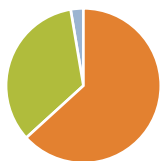
| | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | -0,31 | 3Y Sharpe Ratio | -0,08 |
| 3Y Beta | 1,32 | 3Y Std Dev | 12,07 |
| 3Y R-Squared | 62,63 | 3Y Risk | Alto |
| 3Y Info Ratio | -0,12 | 5Y Risk | Alto |
| 3Y Tracking Error | 7,63 | 10Y Risk | - |

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

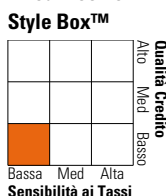
Rendimenti


| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|--------|-------|-------|
| 3-Mesi | 2,51 | 2,41 | 2,41 | 2025 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 6,21 | 4,79 | 5,27 | 2024 | 2,79 | 1,61 | 4,41 | 1,62 |
| 1-Anno | 12,42 | 8,84 | 9,82 | 2023 | -7,46 | 1,94 | 2,53 | 8,57 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,24 | 2,59 | 2,45 | 2022 | -7,12 | -11,70 | -6,57 | 10,35 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,67 | 1,23 | 1,48 | 2021 | 1,62 | 2,38 | 1,49 | -1,34 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 06/02/2025

Portafoglio 31/10/2024


| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 63,24 |
| Liquidità | 34,10 |
| Altro | 2,66 |

Fixed Income Style Box™


| | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Duration Effettiva | - |
| Maturità effettiva | 4,78 |
| Qualità Credito Media | BB |

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|------|------------------|-------|
| AAA | 0,00 | BBB | 28,66 |
| AA | 0,00 | BB | 70,65 |
| A | 0,00 | B | 0,00 |
| | | Below B | 0,00 |
| | | Not Rated | 0,69 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Deutsche Bank AG 10% | - | 5,53 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. 9.125% | - | 5,43 |
| Banco Santander, S.A. 9.625% | - | 4,70 |
| Barclays PLC 9.25% | - | 4,61 |
| Deutsche Bank... | - | 3,93 |
| ABN AMRO Bank N.V. 6.875% | - | 3,92 |
| Credit Agricole S.A. 6.5% | - | 3,65 |
| Virgin Money UK PLC 11% | - | 3,65 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. 5.875% | - | 3,27 |
| Banco Bilbao Vizcaya... | - | 3,25 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 41,95 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 45 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|----------------------------|--------|
| 🏛️ Governativo | -4,85 |
| 🏠 Societario | 91,91 |
| 🏢 Cartolarizzazioni | 0,00 |
| 🏠 Enti Locali | 0,00 |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | -44,64 |
| 📄 Derivati | 57,57 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 0,00 |
| Da 4 a 6 cedole | 13,54 |
| Da 6 a 8 cedole | 32,21 |
| Da 8 a 10 cedole | 50,16 |
| Da 10 a 12 cedole | 4,09 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 16,71 |
| da 3 a 5 | 42,32 |
| da 5 a 7 | 28,58 |
| da 7 a 10 | 12,40 |
| 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 | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | - | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | 1,50% |
| Data di Partenza | 29/06/2017 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,50% |
| Nome del Gestore | James Macdonald | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| | Marc Stacey | ISIN | LU1163203471 | | |
| Data Inizio Gestione | 14/01/2015 | | | | |
| NAV (06/02/2025) | EUR 131,58 | | | | |

BlueBay Funds - BlueBay Financial Capital Bond Fund R - EUR

Patrimonio Netto (Mln) 1.788,36 USD

(31/10/2024)