

BlueBay Structured Funds - Total Return Diversified Credit H EUR

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Globali High Yield - EUR
Hedged

Benchmark Morningstar

Morningstar Global High-Yield Bond GR
Hedged EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

N/A

Morningstar Rating™

Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

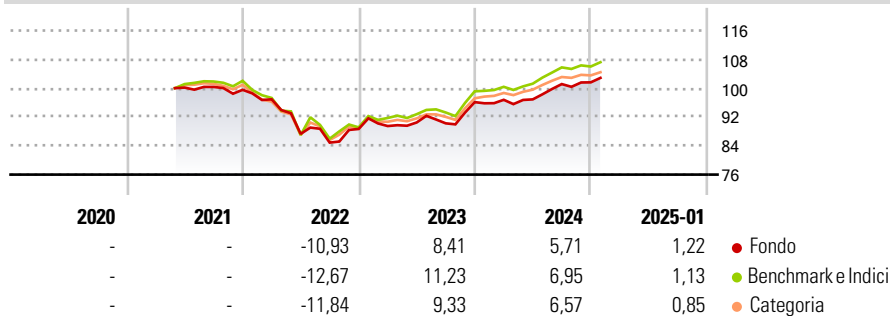
To achieve a total return from investments in higher yielding fixed income asset classes through active security selection, asset allocation and capital preservation techniques. The Sub-Fund invests its net assets predominately in fixed income securities from issuers globally (including Emerging Market Issuers). The Sub-Fund may invest in fixed income securities of any rating, in unrated debt securities and in Distressed Debt Securities. The Sub-Fund may invest up to 25% of its net assets in convertible bonds, warrant-linked bonds and similar convertible instruments issued by domestic or international issuers. The Sub-Fund may invest up to 50% of its net assets in loans.

Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,03	3Y Sharpe Ratio	-0,09
3Y Beta	0,79	3Y Std Dev	7,11
3Y R-Squared	81,20	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,32	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	3,43	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged EUR (dove applicabile)

Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,34	1,64	1,44	2025	-	-	-	-
6-Mesi	4,60	4,43	3,58	2024	0,67	0,11	4,39	0,47
1-Anno	7,41	7,99	6,96	2023	0,92	1,11	-0,28	6,53
3-Anni Ann.ti	1,40	2,71	1,86	2022	-2,65	-9,91	-2,77	4,46
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	0,18	-0,79
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
Azioni	-0,38
Obbligazioni	98,18
Liquidità	-4,97
Altro	7,17

Fixed Income Style Box™

		Qualità Credito	
		Alto	Basso
Sensibilità ai Tassi	Alto		
	Basso		
Duration Effettiva	-		
Maturità effettiva	8,24		
Qualità Credito Media	BB		

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	2,17	BBB	28,57
AA	7,40	BB	32,75
A	8,14	B	14,19
		Below B	6,55
		Not Rated	0,24

Titoli principali

Nome	Settore	%
2 Year Treasury Note Future...	—	25,19
Intesa Sanpaolo S.p.A. 5.875%	—	1,24
Caixabank S.A. 5.875%	—	1,13
Barclays PLC 8.875%	—	1,11
NatWest Group PLC 8.125%	—	0,88
Deutsche Bank AG 10%	—	0,86
BNP Paribas SA 7.75%	—	0,84
Credit Agricole S.A. 6.5%	—	0,83
Banco Bilbao Vizcaya...	—	0,76
Commerzbank AG 6.5%	—	0,73
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		33,58
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		474

Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
🏛️ Governativo	41,24
🏢 Societario	50,45
🏠 Cartolarizzazioni	16,54
🏢 Enti Locali	0,00
🏢 Liquidità ed equivalenti	-56,75
📄 Derivati	48,51

Coupon Range %

	Fondo
0 coupon	4,29
Da 0 a 4 cedole	10,58
Da 4 a 6 cedole	23,27
Da 6 a 8 cedole	35,68
Da 8 a 10 cedole	20,38
Da 10 a 12 cedole	3,69
Oltre 12 cedole	2,11

Scadenze %

	Fondo
da 1 a 3	10,35
da 3 a 5	17,63
da 5 a 7	14,78
da 7 a 10	12,27
da 10 a 15	12,22
da 15 a 20	3,01
da 20 a 30	3,89
oltre 30	2,03

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	-	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	500.000 EUR
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,90%
Data di Partenza	05/05/2021	UCITS	No	Spese correnti	-
Nome del Gestore	Not Disclosed	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/01/2021	ISIN	LU2308615017		
NAV (03/02/2025)	EUR 103,04				
Patrimonio Netto (Mln)	1.260,99 USD				

(31/12/2024)