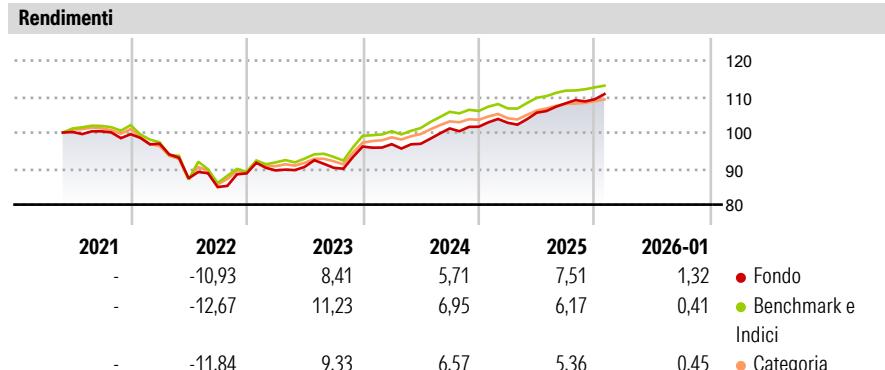


BlueBay Structured Funds - Total Return Diversified Credit H EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Globali High Yield - EUR Hedged	Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged EUR <small>Usato nel Report</small>	N/A	Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiарато

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

Misure di Rischio			
3Y Alpha	-0,40	3Y Sharpe Ratio	0,83
3Y Beta	0,99	3Y Std Dev	4,14%
3Y R-Squared	81,60	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-0,28	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	1,77	10Y Risk	-

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

Part 2: **What's Next?** **Part 3:** **Part 4:** **Part 5:** **Part 6:** **Part 7:** **Part 8:**

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmki	Ci
3-Mesi	1,57	1,40	1,40
6-Mesi	4,42	2,86	2,86
1-Anno	7,79	5,64	5,64
3-Anni Ann.ti	6,28	6,63	5,64
5-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo	Credit Quality %	Fond 0	Credit Quality %	Fond 0
	Duration Effettiva	-			
	Maturity effettiva	8,16			
	Qualità Credito Media	BB	AAA	1,43	BBB
			AA	1,57	BB
			A	4,27	B
				Below B	4,76
				Not Rated	0,25
Bassa	Med	Alta			
Sensibilità ai Tassi					

Titoli principali

Nome	Settore	%
2 Year Treasury Note Future...	—	19,09
Intesa Sanpaolo S.p.A. 5,875%	—	1,31
Credit Agricole S.A. 6,5%	—	1,02
Barclays PLC 8,875%	—	0,98
Commerzbank AG 6,5%	—	0,79
KBC Group NV 6,25%	—	0,78
BNP Paribas SA 7,75%	—	0,76
Deutsche Bank AG 10%	—	0,76
Banco Bilbao Vizcaya...	—	0,73
Banco Santander SA 9,625%	—	0,71
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		26,93
Numero Complessivo di Titoli Azionari		2
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		437

Fixed Income Sector Weightings %		Fondi
 Governativo	46,6	
 Societario	58,9	
 Cartolarizzazioni	13,0	
 Enti Locali	0,0	
 Liquidità ed equivalenti	-65,7	
 Derivati	46,6	
Coupon Range %		Fondi
0 coupon	6,4	
Da 0 a 4 cedole	6,4	
Da 4 a 6 cedole	23,7	
Da 6 a 8 cedole	37,7	
Da 8 a 10 cedole	21,1	
Da 10 a 12 cedole	2,2	
Ulta 12 cedole	1,1	

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	14,38
da 3 a 5	19,06
da 5 a 7	17,91
da 7 a 10	10,96
da 10 a 15	12,84
da 15 a 20	1,92
da 20 a 30	3,79
oltre 30	113

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln) (03/02/2026)	112,45 EUR	Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo	1.000.000 EUR 500.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,90%
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	-
Data di Partenza	05/05/2021	UCITS	No	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	Not Disclosed	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	01/01/2021	ISIN	LU2308615017		
NAV (03/02/2026)	EUR 111,07				
Patrimonio Netto (Mln)	1.294,12 USD				
(31/12/2025)					