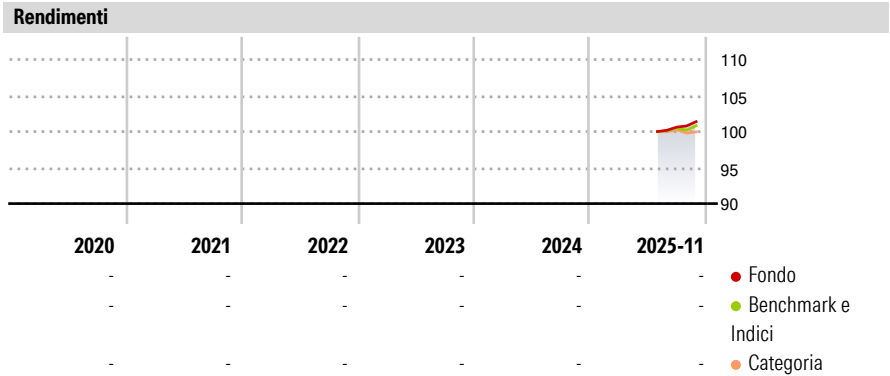


BlueBay Structured Funds - High Income Loan Fund L EUR (MFDiv)

<b>Categoria Morningstar™</b>	<b>Benchmark Morningstar</b>	<b>Benchmark Dichiarato</b>	<b>Morningstar Rating™</b>
Category_EUCA001028	Morningstar European Leveraged Loan TR	Credit Suisse WstEur Lev Loan TR Hdg EUR	Senza rating
	EUR		
	Usato nel Report		

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

To achieve a total rate of return in excess of the Credit Suisse Western European Leverage Loan Index non US (Euro hedged) on a gross annualised basis from a portfolio of loans and other senior secured debt obligations issued by corporate borrowers who are predominantly rated below Investment Grade. The Sub-Fund invests predominantly in first and second lien loans or other senior secured debt obligations issued by corporate borrowers who are rated below Investment Grade. The Sub-Fund invests at least 50% of its net assets in entities domiciled in European Union countries and the UK whose sovereign long term debt rating is Investment Grade. At least 50% of Sub-Fund's net assets will be denominated in the currencies of countries which are...



Misure di Rischio		
3Y Alpha	- 3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	- 3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-

Basati su Morningstar European Leveraged Loan TR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,27	0,77	-1,02	2025	-	-	-	-
6-Mesi	-	-	-	2024	-	-	-	-
1-Anno	-	-	-	2023	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 10/12/2025

**Portafoglio 31/10/2025**

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,22
● Obbligazioni	112,84
● Liquidità	-13,05
● Altro	0,00

**Fixed Income Style Box™**

Duration Effettiva: -  
Maturità effettiva: -  
Qualità Credito Media: -

Qualità Credito: Alto, Med, Basso  
Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
	0		0

Titoli principali		
Nome	Settore	%
MOTFUE TL B10 1L GBP	—	2,77
ZEGLN TL B1 1L EUR	—	2,66
BOOTFN TL B 1L GBP	—	2,49
ACTINA TL B9 1L EUR	—	2,25
EAGBID TL B 1L EUR	—	2,06
Fibercop S.p.A. 5.026%	—	1,99
UNSEAM TL B 1L EUR	—	1,88
SWPORT TL B3 1L EUR	—	1,70
COGNTA TL B3A 1L EUR	—	1,64
MASSM TL B 1L EUR	—	1,57
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		21,01
Numero Complessivo di Titoli Azionari		1
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		192

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
🏛️ Governativo	0,00
⚙️ Societario	113,08
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
👤 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	-4,61
📄 Derivati	-8,47
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	1,45
Da 4 a 6 cedole	70,98
Da 6 a 8 cedole	17,91
Da 8 a 10 cedole	9,67
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	11,26
da 3 a 5	29,85
da 5 a 7	58,57
da 7 a 10	0,00
da 10 a 15	0,00
da 15 a 20	0,00
da 20 a 30	0,00
oltre 30	0,23

Anagrafica			
Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	0,37 EUR
Telefono	-	(10/12/2025)	
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO
Data di Partenza	11/07/2025	Valuta del Fondo	EUR
Nome del Gestore	Ashley Wright	UCITS	No
	Sid Chhabra	Inc/Acc	Inc
	Tim van der Weyden	ISIN	LU1055793654
Data Inizio Gestione	29/07/2024	Investimento Min. Ingresso	125.000 EUR
		Investimento Min. Successivo	50.000 EUR
		T.E.R.	1,30%
		Spese correnti	-
		Commissione di incentivo	-

# BlueBay Structured Funds - High Income Loan Fund L EUR (MFDiv)

NAV <sup>(10/12/2025)</sup>	EUR 99,66
Patrimonio Netto (Mln)	238,31 EUR
<sup>(31/10/2025)</sup>	