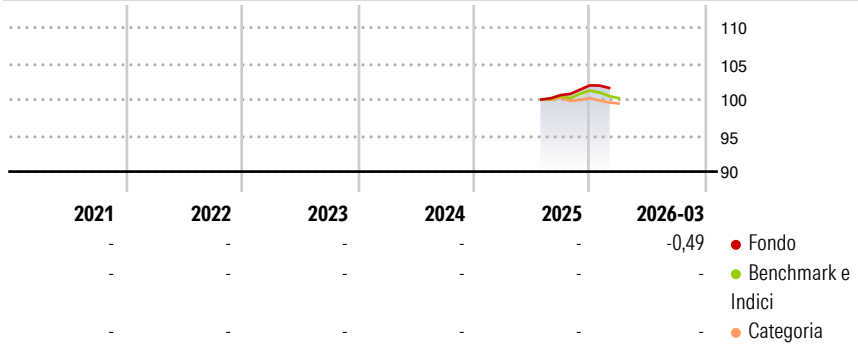
# BlueBay Structured Funds - High Income Loan Fund L EUR (MFDiv)

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

## 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...

## Rendimenti




## 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 |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -0,36 | 0,19 | 1,34 |
| 6-Mesi | 0,86 | 1,32 | 2,79 |
| 1-Anno | - | 3,22 | 3,09 |
| 3-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 19/03/2026

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | - | - | - | 1,33 |
| 2024 | - | - | - | - |
| 2023 | - | - | - | - |
| 2022 | - | - | - | - |

## Portafoglio 30/09/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,23 |
| Obbligazioni | 109,38 |
| Liquidità | -9,61 |
| Altro | 0,00 |

| Fixed Income Style Box™ | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | - |
| Maturity effettiva | - |
| Qualità Credito Media | |




| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|

### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| MOTFUE TL B12 1L GBP | — | 3,39 |
| BOOTFN TL B 1L GBP | — | 2,99 |
| EAGBID TL B 1L GBP | — | 2,85 |
| SAZGR TL B 1L GBP | — | 2,61 |
| ACTINA TL B9 1L EUR | — | 2,14 |
| BELRON TL B 1L EUR | — | 2,01 |
| MATTER TL B4 1L EUR | — | 2,01 |
| TICBID TL B2 1L GBP | — | 1,84 |
| EURMED TL B2 1L EUR | — | 1,72 |
| ZENTIV TL B 1L EUR | — | 1,61 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 23,18 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 2 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 171 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 109,64 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 11,26 |
| Derivati | -20,89 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 0,46 |
| Da 4 a 6 cedole | 48,35 |
| Da 6 a 8 cedole | 35,44 |
| Da 8 a 10 cedole | 15,75 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 13,14 |
| da 3 a 5 | 28,42 |
| da 5 a 7 | 57,93 |
| da 7 a 10 | 0,31 |
| da 10 a 15 | 0,00 |
| da 15 a 20 | 0,00 |
| da 20 a 30 | 0,00 |
| oltre 30 | 0,20 |

## Anagrafica

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (MIn) (19/03/2026) | 0,12 EUR | Investimento Min. Ingresso | 125.000 EUR |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | 50.000 EUR |
| Web | www.bluebayinvest.com | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | 1,30% |
| Data di Partenza | 11/07/2025 | UCITS | No | Spese correnti | - |
| Nome del Gestore | Ashley Wright<br>Sid Chhabra<br>Tim van der Weyden | Inc/Acc | Inc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 29/07/2024 | ISIN | LU1055793654 | | |

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

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

| | |
|---|---|
| NAV (19/03/2026) | EUR 97,84 |
| Patrimonio Netto (MIn) (30/09/2026) | 204,06 EUR |

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.