

BlueBay Funds - BlueBay Financial Capital Bond Fund - S - USD accumulating

| | | | |
|-------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Obbligazionari Altro | Not Categorized Usato nel Report | No benchmark | Senza 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...



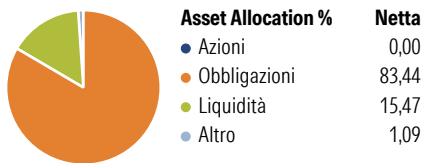
Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|---|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,42 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 11,01 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo | Rendimenti | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|---------------|-------|-------|------|-------|
| 3-Mesi | -0,74 | Trimestrali % | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 4,02 | 2026 | - | - | - | - |
| 1-Anno | -2,18 | 2025 | -3,07 | -4,90 | 3,32 | 2,43 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,88 | 2024 | 5,73 | 3,01 | 0,90 | 10,13 |
| 5-Anni Ann.ti | - | 2023 | -8,36 | 2,23 | 6,30 | 4,71 |
| 10-Anni Ann.ti | - | 2022 | -4,50 | -5,36 | 0,54 | 2,32 |

Rendimenti aggiornati al 27/01/2026

Portafoglio 30/09/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|-------------------------|-------|------------------|------|------------------|-------|
| Duration Effettiva | - | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Maturity effettiva | 5,39 | AAA | 0,00 | BBB | 38,20 |
| Qualità Credito Media | BB | AA | 0,00 | BB | 58,18 |
| | | A | 0,00 | B | 3,08 |
| | | | | Below B | 0,00 |
| | | | | Not Rated | 0,54 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Deutsche Bank... | — | 6,17 |
| Erste Group Bank AG 6.375% | — | 4,91 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. 9.125% | — | 4,17 |
| Societe Generale S.A. 10% | — | 4,16 |
| Barclays PLC 9.25% | — | 3,93 |
| Virgin Money UK PLC 11% | — | 3,75 |
| Barclays PLC 8.375% | — | 3,67 |
| Credit Agricole S.A. 6.5% | — | 3,37 |
| Banco Santander, S.A. 9.625% | — | 3,37 |
| ABN AMRO Bank N.V. 6.875% | — | 2,94 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 40,45 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 54 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo | Scadenze % | Fondo |
|----------------------------------|--------|------------|-------|
| Governativo | 0,00 | da 1 a 3 | 12,03 |
| Societario | 95,37 | da 3 a 5 | 30,49 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 | da 5 a 7 | 38,61 |
| Enti Locali | 0,00 | da 7 a 10 | 18,81 |
| Liquidità ed equivalenti | -68,78 | da 10 a 15 | 0,00 |
| Derivati | 73,41 | da 15 a 20 | 0,00 |
| | | da 20 a 30 | 0,00 |
| | | oltre 30 | 0,00 |
| Coupon Range % | Fondo | | |
| 0 coupon | 0,00 | | |
| Da 0 a 4 cedole | 0,00 | | |
| Da 4 a 6 cedole | 6,52 | | |
| Da 6 a 8 cedole | 53,07 | | |
| Da 8 a 10 cedole | 33,77 | | |
| Da 10 a 12 cedole | 3,93 | | |
| Oltre 12 cedole | 2,71 | | |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,86 USD | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | - | (27/01/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,80% |
| Data di Partenza | 05/02/2015 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 0,80% |
| Nome del Gestore | James Macdonald | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| | Marc Stacey | Inc/Acc | Acc | | |
| Data Inizio Gestione | 14/01/2015 | ISIN | LU1163205252 | | |
| NAV (27/01/2026) | USD 121,23 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 2.580,86 USD | | | | |
| (30/09/2025) | | | | | |