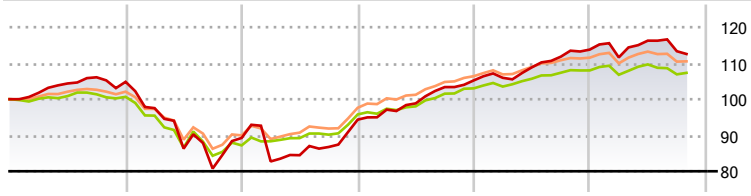
# BlueBay Funds - BlueBay Financial Capital Bond Fund - Q - EUR accumulating

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Category_EUCA000922 | Markit iBoxx EUR Corp Subordinated TR<br>Usato nel Report | Not Benchmarked | ★★★★ |

## 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...

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 4,83 | -14,86 | 5,69 | 11,54 | 8,13 | -1,07 |
| Benchmark e Indici | 0,66 | -13,40 | 9,86 | 7,56 | 4,84 | -0,62 |
| Categoria | 2,14 | -12,10 | 8,49 | 9,15 | 5,08 | -0,95 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | 1,90 | 3Y Sharpe Ratio | 1,20 |
| 3Y Beta | 1,31 | 3Y Std Dev | 4,98 |
| 3Y R-Squared | 82,09 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 1,27 | 5Y Risk | Alto |
| 3Y Tracking Error | 2,32 | 10Y Risk | Alto |

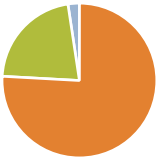
Basati su Markit iBoxx EUR Corp Subordinated TR (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -2,39 | -1,38 | -1,75 |
| 6-Mesi | -0,07 | -0,24 | -0,54 |
| 1-Anno | 1,02 | -0,11 | -0,11 |
| 3-Anni Ann.ti | 8,94 | 5,68 | 6,82 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,59 | 1,33 | 1,91 |
| 10-Anni Ann.ti | 5,35 | 2,64 | 3,17 |

Rendimenti aggiornati al 12/11/2026

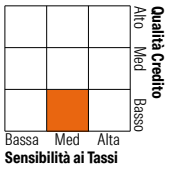
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -1,90 | 4,16 | -2,52 | - |
| 2025 | 0,69 | 2,73 | 2,72 | 1,76 |
| 2024 | 2,95 | 1,79 | 4,57 | 1,79 |
| 2023 | -7,31 | 2,09 | 2,70 | 8,75 |
| 2022 | -6,97 | -11,53 | -6,41 | 10,53 |

## Portafoglio 31/07/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,02 |
| Obbligazioni | 75,86 |
| Liquidità | 21,75 |
| Altro | 2,38 |

**Fixed Income Style Box™**




| | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 4,53 |
| Maturity effettiva | 5,96 |
| Qualità Credito Media | BB |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 0,00 | BBB | 43,97 |
| AA | 0,00 | BB | 50,54 |
| A | 0,00 | B | 3,28 |
| | | Below B | 0,00 |
| | | Not Rated | 2,20 |

### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| Barclays PLC 8.375% | — | 6,04 |
| Deutsche Bank... | — | 5,38 |
| Erste Group Bank AG 6.375% | — | 5,00 |
| BNP Paribas Cardif SA 6% | — | 4,44 |
| Banco Santander SA 9.625% | — | 4,22 |
| Credit Agricole S.A. 5.875% | — | 3,46 |
| Deutsche Bank AG 6.75% | — | 3,44 |
| Virgin Money UK Ltd. 11% | — | 3,35 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. 5.875% | — | 3,28 |
| Banco de Sabadell SA 6.5% | — | 3,21 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 41,81 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 42 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 96,13 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | -58,42 |
| Derivati | 62,28 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 0,00 |
| Da 4 a 6 cedole | 15,55 |
| Da 6 a 8 cedole | 59,84 |
| Da 8 a 10 cedole | 18,24 |
| Da 10 a 12 cedole | 3,50 |
| Oltre 12 cedole | 2,88 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 6,37 |
| da 3 a 5 | 18,09 |
| da 5 a 7 | 44,07 |
| da 7 a 10 | 29,66 |
| da 10 a 15 | 0,00 |
| da 15 a 20 | 0,00 |
| da 20 a 30 | 0,00 |
| oltre 30 | 0,00 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| Telefono | - |
| Web | www.bluebayinvest.com |
| Data di Partenza | 30/04/2015 |
| Nome del Gestore | James Macdonald<br>Marc Stacey |
| Data Inizio Gestione | 14/01/2015 |
| NAV (12/11/2026) | EUR 172,84 |
| Patrimonio Netto (Mln) (31/07/2026) | 2.009,58 USD |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) (12/11/2026) | 27,54 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU1163205096 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,85% |
| Spese correnti | 0,85% |
| Commissione di incentivo | - |

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.

MORNINGSTAR