

QSF - Quaestio European High Yield Bond Fund Class RA

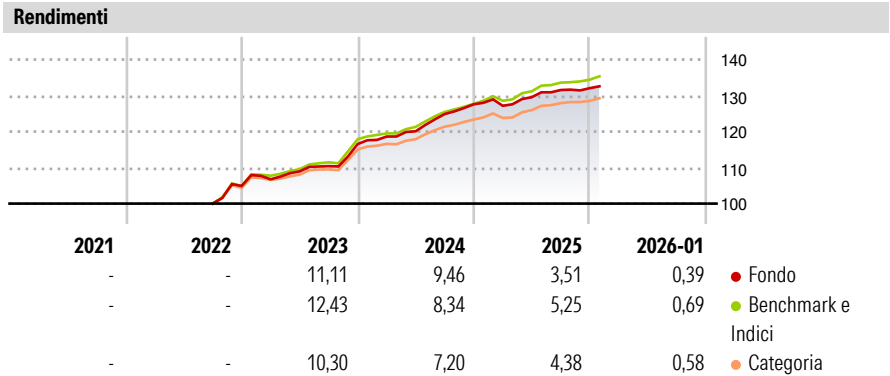
| | | | |
|-------------------------------|-----------------------------------------------------------------|----------------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Obbligazionari High Yield EUR | Morningstar Eurozone High-Yield Bond GR EUR Usato nel Report | ICE BofA Euro High Yield TR HEUR | ★★★ |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Quaestio European High Yield Bond investe nel mercato High Yield europeo attraverso un portafoglio di natura discrezionale e ad alta convinzione, con un numero di emittenti compreso tra 75 e 95. Il numero di emittenti in portafoglio può aumentare o diminuire in funzione del contesto macroeconomico e delle prospettive di mercato. Il portafoglio adotta uno stile prevalentemente quality, favorendo l'esposizione verso società operanti in settori ad alta stabilità di ricavi e margini e, ove possibile, con moderata leva finanziaria.

| Misure di Rischio | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | -0,70 | 3Y Sharpe Ratio | 1,46 |
| 3Y Beta | 1,02 | 3Y Std Dev | 2,78 |
| 3Y R-Squared | 91,26 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,83 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 0,80 | 10Y Risk | - |

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



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|------|------|------|
| 3-Mesi | 0,95 | 1,53 | 1,16 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 1,19 | 2,06 | 1,66 | 2025 | -0,33 | 1,88 | 1,53 | 0,40 |
| 1-Anno | 3,32 | 5,06 | 4,15 | 2024 | 1,79 | 1,23 | 3,99 | 2,17 |
| 3-Anni Ann.ti | 6,69 | 7,47 | 6,40 | 2023 | 1,79 | 2,05 | 1,34 | 5,56 |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - | 2022 | - | - | - | 4,89 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 09/02/2026

Portafoglio 31/10/2025



| Fixed Income Style | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Box™ | |
| Duration Effettiva | 2,77 |
| Maturity effettiva | 4,71 |
| Qualità Credito Media | B |

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

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|------|------------------|-------|
| AAA | 1,63 | BBB | 0,00 |
| AA | 0,00 | BB | 50,00 |
| A | 0,00 | B | 37,25 |
| | | Below B | 5,07 |
| | | Not Rated | 6,05 |

| Titoli principali | | |
|---------------------------------------------|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| Tk Elevator Midco GmbH | — | 1,81 |
| Telefonica Europe B V | — | 1,60 |
| CMA CGM SA | — | 1,53 |
| ZF Finance GmbH | — | 1,51 |
| Softbank Group Corp. | — | 1,46 |
| Fibercop S.p.A. | — | 1,44 |
| IKB Deutsche Industriebank AG | — | 1,41 |
| Verisure Holding AB (publ) | — | 1,36 |
| Oeg Finance PLC | — | 1,34 |
| British Telecommunications PLC | — | 1,34 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 14,80 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 105 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|----------------------------------|-------|
| Governativo | 0,00 |
| Societario | 98,35 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | -0,17 |
| Derivati | 1,82 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 14,22 |
| Da 4 a 6 cedole | 46,25 |
| Da 6 a 8 cedole | 29,82 |
| Da 8 a 10 cedole | 8,35 |
| Da 10 a 12 cedole | 1,35 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 11,70 |
| da 3 a 5 | 39,91 |
| da 5 a 7 | 25,82 |
| da 7 a 10 | 3,72 |
| da 10 a 15 | 0,00 |
| da 15 a 20 | 0,00 |
| da 20 a 30 | 1,36 |
| oltre 30 | 17,48 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|----------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|---|
| Società di Gestione | Quaestio Capital SGR S.p.A | Patrimonio Classe (Mln) | 4,65 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | (09/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 09/09/2022 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | - |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 13/12/2023 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (09/02/2026) | EUR 12,75 | ISIN | LU0981470551 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 332,55 EUR | | | | |

(31/10/2025)