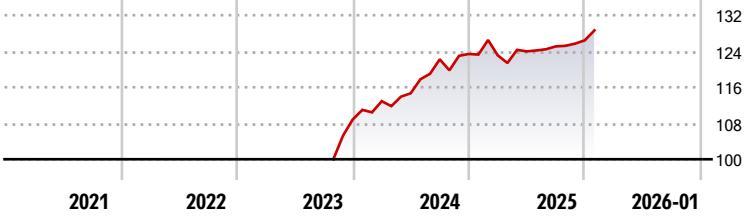


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Financials Plus Bond Fund C GBP (QCDiv)

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™																																																		
Obbligazionari Altro	Not Categorized	N/A	Senza rating																																																		
Obiettivo d'Investimento Dichiarato																																																					
The Sub-Fund is actively managed, does not reference any benchmark and aims to achieve a total return from a portfolio of investment grade-rated fixed income and subordinated debt securities issued by financial institutions while taking into account ESG considerations.																																																					
<p>Misure di Rischio</p> <table> <tr> <td>3Y Alpha</td><td>-</td><td>3Y Sharpe Ratio</td><td>-</td></tr> <tr> <td>3Y Beta</td><td>-</td><td>3Y Std Dev</td><td>-</td></tr> <tr> <td>3Y R-Squared</td><td>-</td><td>3Y Risk</td><td>-</td></tr> <tr> <td>3Y Info Ratio</td><td>-</td><td>5Y Risk</td><td>-</td></tr> <tr> <td>3Y Tracking Error</td><td>-</td><td>10Y Risk</td><td>-</td></tr> </table>				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	-																														
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	-																																																		
<p>Portafoglio 30/09/2025</p>  <table> <thead> <tr> <th>Asset Allocation %</th> <th>Netta</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Azioni</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>Obbligazioni</td> <td>63,16</td> </tr> <tr> <td>Liquidità</td> <td>35,33</td> </tr> <tr> <td>Altro</td> <td>1,51</td> </tr> </tbody> </table>				Asset Allocation %	Netta	Azioni	0,00	Obbligazioni	63,16	Liquidità	35,33	Altro	1,51																																								
Asset Allocation %	Netta																																																				
Azioni	0,00																																																				
Obbligazioni	63,16																																																				
Liquidità	35,33																																																				
Altro	1,51																																																				
<p>Titoli principali</p> <table> <thead> <tr> <th>Nome</th> <th>Settore</th> <th>%</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>BNP Paribas SA 3.945%</td> <td>—</td> <td>5,11</td> </tr> <tr> <td>ING Groep N.V. 3.875%</td> <td>—</td> <td>3,53</td> </tr> <tr> <td>NatWest Group PLC 3.723%</td> <td>—</td> <td>3,30</td> </tr> <tr> <td>Allianz SE 4.431%</td> <td>—</td> <td>3,15</td> </tr> <tr> <td>Bupa Finance PLC 4.125%</td> <td>—</td> <td>2,93</td> </tr> <tr> <td>Banco Bilbao Vizcaya...</td> <td>—</td> <td>2,57</td> </tr> <tr> <td>Citigroup Inc. 4.296%</td> <td>—</td> <td>2,57</td> </tr> <tr> <td>Deutsche Bank AG New York...</td> <td>—</td> <td>2,53</td> </tr> <tr> <td>Credit Agricole S.A. 5.875%</td> <td>—</td> <td>2,48</td> </tr> <tr> <td>Lloyds Banking Group PLC 4%</td> <td>—</td> <td>2,42</td> </tr> <tr> <td>% Primi 10 Titoli sul Patrimonio</td> <td>30,59</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Numeri Complessivo di Titoli Azionari</td> <td>0</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari</td> <td>57</td> <td></td> </tr> </tbody> </table>				Nome	Settore	%	BNP Paribas SA 3.945%	—	5,11	ING Groep N.V. 3.875%	—	3,53	NatWest Group PLC 3.723%	—	3,30	Allianz SE 4.431%	—	3,15	Bupa Finance PLC 4.125%	—	2,93	Banco Bilbao Vizcaya...	—	2,57	Citigroup Inc. 4.296%	—	2,57	Deutsche Bank AG New York...	—	2,53	Credit Agricole S.A. 5.875%	—	2,48	Lloyds Banking Group PLC 4%	—	2,42	% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	30,59		Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0		Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	57									
Nome	Settore	%																																																			
BNP Paribas SA 3.945%	—	5,11																																																			
ING Groep N.V. 3.875%	—	3,53																																																			
NatWest Group PLC 3.723%	—	3,30																																																			
Allianz SE 4.431%	—	3,15																																																			
Bupa Finance PLC 4.125%	—	2,93																																																			
Banco Bilbao Vizcaya...	—	2,57																																																			
Citigroup Inc. 4.296%	—	2,57																																																			
Deutsche Bank AG New York...	—	2,53																																																			
Credit Agricole S.A. 5.875%	—	2,48																																																			
Lloyds Banking Group PLC 4%	—	2,42																																																			
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	30,59																																																				
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0																																																				
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	57																																																				
<p>Anagrafica</p> <table> <tr> <td>Società di Gestione</td> <td>BlueBay Funds Management Company S.A.</td> <td>Patrimonio Classe (Mln)</td> <td>0,07 GBP</td> <td>Investimento Min. Ingresso</td> </tr> <tr> <td>Telefono</td> <td>-</td> <td>(10/02/2026)</td> <td></td> <td>Investimento Min. Successivo</td> </tr> <tr> <td>Web</td> <td>www.bluebayinvest.com</td> <td>Domicilio</td> <td>LUSSEMBURGO</td> <td>T.E.R.</td> </tr> <tr> <td>Data di Partenza</td> <td>18/10/2023</td> <td>Valuta del Fondo</td> <td>GBP</td> <td>Spese correnti</td> </tr> <tr> <td>Nome del Gestore</td> <td>James Macdonald</td> <td>UCITS</td> <td>Si</td> <td>Commissione di incentivo</td> </tr> <tr> <td></td> <td>James Pettit</td> <td>Inc/Acc</td> <td>Inc</td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>Marc Stacey</td> <td>ISIN</td> <td>LU2674536599</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Data Inizio Gestione</td> <td>09/06/2023</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>NAV (10/02/2026)</td> <td>GBP 101,06</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Patrimonio Netto (Mln)</td> <td>120,55 USD</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </table>				Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	0,07 GBP	Investimento Min. Ingresso	Telefono	-	(10/02/2026)		Investimento Min. Successivo	Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	Data di Partenza	18/10/2023	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	Nome del Gestore	James Macdonald	UCITS	Si	Commissione di incentivo		James Pettit	Inc/Acc	Inc			Marc Stacey	ISIN	LU2674536599		Data Inizio Gestione	09/06/2023				NAV (10/02/2026)	GBP 101,06				Patrimonio Netto (Mln)	120,55 USD			
Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	0,07 GBP	Investimento Min. Ingresso																																																	
Telefono	-	(10/02/2026)		Investimento Min. Successivo																																																	
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.																																																	
Data di Partenza	18/10/2023	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti																																																	
Nome del Gestore	James Macdonald	UCITS	Si	Commissione di incentivo																																																	
	James Pettit	Inc/Acc	Inc																																																		
	Marc Stacey	ISIN	LU2674536599																																																		
Data Inizio Gestione	09/06/2023																																																				
NAV (10/02/2026)	GBP 101,06																																																				
Patrimonio Netto (Mln)	120,55 USD																																																				
(30/09/2025)																																																					
<p>Rendimenti</p>  <table> <thead> <tr> <th>Periodo</th> <th>Rend. Cumulati %</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2021</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2022</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2023</td> <td>13,37</td> </tr> <tr> <td>2024</td> <td>2,46</td> </tr> <tr> <td>2025</td> <td>1,75</td> </tr> <tr> <td>2026-01</td> <td>1,75</td> </tr> </tbody> </table> <p>● Fondo</p>				Periodo	Rend. Cumulati %	2021	-	2022	-	2023	13,37	2024	2,46	2025	1,75	2026-01	1,75																																				
Periodo	Rend. Cumulati %																																																				
2021	-																																																				
2022	-																																																				
2023	13,37																																																				
2024	2,46																																																				
2025	1,75																																																				
2026-01	1,75																																																				
<table> <thead> <tr> <th>Rend. Cumulati %</th> <th>Fondo</th> <th>Rendimenti Trimestrali %</th> <th>Q1</th> <th>Q2</th> <th>Q3</th> <th>Q4</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>3-Mesi</td> <td>2,82</td> <td>2026</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>6-Mesi</td> <td>3,48</td> <td>2025</td> <td>-0,24</td> <td>0,72</td> <td>0,89</td> <td>1,07</td> </tr> <tr> <td>1-Anno</td> <td>2,95</td> <td>2024</td> <td>3,74</td> <td>1,56</td> <td>6,58</td> <td>0,96</td> </tr> <tr> <td>3-Anni Ann.ti</td> <td>-</td> <td>2023</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>5-Anni Ann.ti</td> <td>-</td> <td>2022</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>10-Anni Ann.ti</td> <td>-</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>Rendimenti aggiornati al 10/02/2026</p>				Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4	3-Mesi	2,82	2026	-	-	-	-	6-Mesi	3,48	2025	-0,24	0,72	0,89	1,07	1-Anno	2,95	2024	3,74	1,56	6,58	0,96	3-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	-	-	5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-	10-Anni Ann.ti	-						
Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4																																															
3-Mesi	2,82	2026	-	-	-	-																																															
6-Mesi	3,48	2025	-0,24	0,72	0,89	1,07																																															
1-Anno	2,95	2024	3,74	1,56	6,58	0,96																																															
3-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	-	-																																															
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-																																															
10-Anni Ann.ti	-																																																				
<p>Fixed Income Style Box™</p> <table> <thead> <tr> <th>Style</th> <th>Box</th> <th>Duration Effettiva</th> <th>Fondo</th> <th>Credit Quality %</th> <th>Fondo</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Box</td> <td>Qualità Credito</td> <td>Maturity effettiva</td> <td>-</td> <td>Fond o</td> <td>Fond o</td> </tr> <tr> <td>Box</td> <td>Alto</td> <td>Qualità Credito Media</td> <td>-</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Box</td> <td>Med</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Box</td> <td>Basso</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>Sensibilità ai Tassi</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>Bassa Med Alta</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>				Style	Box	Duration Effettiva	Fondo	Credit Quality %	Fondo	Box	Qualità Credito	Maturity effettiva	-	Fond o	Fond o	Box	Alto	Qualità Credito Media	-			Box	Med	-	-			Box	Basso	-	-					Sensibilità ai Tassi						Bassa Med Alta											
Style	Box	Duration Effettiva	Fondo	Credit Quality %	Fondo																																																
Box	Qualità Credito	Maturity effettiva	-	Fond o	Fond o																																																
Box	Alto	Qualità Credito Media	-																																																		
Box	Med	-	-																																																		
Box	Basso	-	-																																																		
		Sensibilità ai Tassi																																																			
		Bassa Med Alta																																																			
<p>Fixed Income Sector Weightings %</p> <table> <thead> <tr> <th>Style</th> <th>Box</th> <th>Fondo</th> <th>Scadenze %</th> <th>Fondo</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Governativo</td> <td>-</td> <td>-16,27</td> <td>da 1 a 3</td> <td>5,60</td> </tr> <tr> <td>Societario</td> <td>-</td> <td>93,19</td> <td>da 3 a 5</td> <td>6,04</td> </tr> <tr> <td>Cartolarizzazioni</td> <td>-</td> <td>0,00</td> <td>da 5 a 7</td> <td>2,65</td> </tr> <tr> <td>Enti Locali</td> <td>-</td> <td>0,00</td> <td>da 7 a 10</td> <td>34,81</td> </tr> <tr> <td>Liquidità ed equivalenti</td> <td>-</td> <td>-43,78</td> <td>da 10 a 15</td> <td>21,28</td> </tr> <tr> <td>Derivati</td> <td>-</td> <td>66,86</td> <td>da 15 a 20</td> <td>7,54</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>da 20 a 30</td> <td>15,49</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>oltre 30</td> <td>6,60</td> </tr> </tbody> </table>				Style	Box	Fondo	Scadenze %	Fondo	Governativo	-	-16,27	da 1 a 3	5,60	Societario	-	93,19	da 3 a 5	6,04	Cartolarizzazioni	-	0,00	da 5 a 7	2,65	Enti Locali	-	0,00	da 7 a 10	34,81	Liquidità ed equivalenti	-	-43,78	da 10 a 15	21,28	Derivati	-	66,86	da 15 a 20	7,54				da 20 a 30	15,49				oltre 30	6,60					
Style	Box	Fondo	Scadenze %	Fondo																																																	
Governativo	-	-16,27	da 1 a 3	5,60																																																	
Societario	-	93,19	da 3 a 5	6,04																																																	
Cartolarizzazioni	-	0,00	da 5 a 7	2,65																																																	
Enti Locali	-	0,00	da 7 a 10	34,81																																																	
Liquidità ed equivalenti	-	-43,78	da 10 a 15	21,28																																																	
Derivati	-	66,86	da 15 a 20	7,54																																																	
			da 20 a 30	15,49																																																	
			oltre 30	6,60																																																	
<p>Coupon Range %</p> <table> <thead> <tr> <th>Style</th> <th>Box</th> <th>Fondo</th> <th>Scadenze %</th> <th>Fondo</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>0 coupon</td> <td>-</td> <td>0,00</td> <td>da 1 a 3</td> <td>5,60</td> </tr> <tr> <td>Da 0 a 4 cedole</td> <td>-</td> <td>19,90</td> <td>da 3 a 5</td> <td>6,04</td> </tr> <tr> <td>Da 4 a 6 cedole</td> <td>-</td> <td>36,13</td> <td>da 5 a 7</td> <td>2,65</td> </tr> <tr> <td>Da 6 a 8 cedole</td> <td>-</td> <td>34,17</td> <td>da 7 a 10</td> <td>34,81</td> </tr> <tr> <td>Da 8 a 10 cedole</td> <td>-</td> <td>5,78</td> <td>da 10 a 15</td> <td>21,28</td> </tr> <tr> <td>Da 10 a 12 cedole</td> <td>-</td> <td>4,02</td> <td>da 15 a 20</td> <td>7,54</td> </tr> <tr> <td>Oltre 12 cedole</td> <td>-</td> <td>0,00</td> <td>da 20 a 30</td> <td>15,49</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>oltre 30</td> <td>6,60</td> </tr> </tbody> </table>				Style	Box	Fondo	Scadenze %	Fondo	0 coupon	-	0,00	da 1 a 3	5,60	Da 0 a 4 cedole	-	19,90	da 3 a 5	6,04	Da 4 a 6 cedole	-	36,13	da 5 a 7	2,65	Da 6 a 8 cedole	-	34,17	da 7 a 10	34,81	Da 8 a 10 cedole	-	5,78	da 10 a 15	21,28	Da 10 a 12 cedole	-	4,02	da 15 a 20	7,54	Oltre 12 cedole	-	0,00	da 20 a 30	15,49				oltre 30	6,60					
Style	Box	Fondo	Scadenze %	Fondo																																																	
0 coupon	-	0,00	da 1 a 3	5,60																																																	
Da 0 a 4 cedole	-	19,90	da 3 a 5	6,04																																																	
Da 4 a 6 cedole	-	36,13	da 5 a 7	2,65																																																	
Da 6 a 8 cedole	-	34,17	da 7 a 10	34,81																																																	
Da 8 a 10 cedole	-	5,78	da 10 a 15	21,28																																																	
Da 10 a 12 cedole	-	4,02	da 15 a 20	7,54																																																	
Oltre 12 cedole	-	0,00	da 20 a 30	15,49																																																	
			oltre 30	6,60																																																	

© 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.