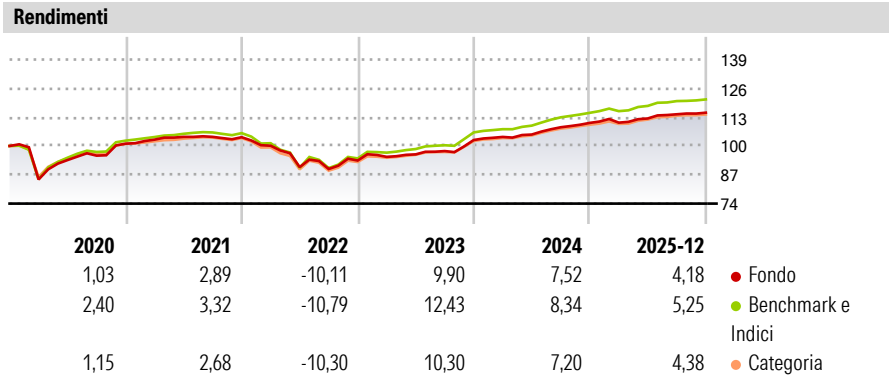


BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund R - EUR (AIDiv)

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari High Yield EUR	Morningstar Eurozone High-Yield Bond GR	ICE BofA Euran Ccy HY Constnd TR HEUR	★★★
	EUR		
	Usato nel Report		

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Conseguire un rendimento totale superiore a quello dell'indice Merrill Lynch European Currency High Yield Constrained Index, investendo in un portafoglio di titoli a reddito fisso. Il Comparto investe almeno due terzi del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating inferiore a investment grade. Il Comparto può investire fino un terzo del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating investment grade. Di norma, almeno il 50% del suo patrimonio netto sarà investito in titoli a reddito fisso* emessi da entità domiciliate in paesi europei i cui titoli di stato a lungo termine abbiano un rating investment grade ovvero da entità domiciliate altrove, a condizione che l'emittente abbia una società capogruppo domiciliata in un...



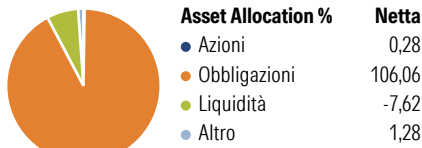
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-1,55	3Y Sharpe Ratio	1,30
3Y Beta	1,04	3Y Std Dev	3,14
3Y R-Squared	96,33	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-2,40	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	0,61	10Y Risk	Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	1,34	1,34	0,68	Trimestrali %				
6-Mesi	2,52	2,57	1,83	2026	-	-	-	-
1-Anno	4,81	5,86	4,60	2025	0,11	1,70	1,68	0,63
3-Anni Ann.ti	7,02	8,41	7,02	2024	1,35	1,04	3,12	1,81
5-Anni Ann.ti	2,62	3,36	2,72	2023	1,76	1,19	1,54	5,11
10-Anni Ann.ti	3,18	4,22	3,43	2022	-3,70	-9,63	-0,94	4,27

Rendimenti aggiornati al 08/01/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Box™			0		0
Duration Effettiva	-	AAA	0,00	BBB	2,86
Maturity effettiva	4,30	AA	0,00	BB	48,33
Qualità Credito Media	B	A	0,00	B	40,19
				Below B	8,62
				Not Rated	0,00

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Euro Schatz Future Dec 25	—	10,53
Euro Bobl Future Dec 25	—	2,55
Sunrise Finco I B.V 4.625%	—	1,88
Fibercop S.p.A. 4.75%	—	1,78
Lorca Telecom Bondco S.A.U. 4%	—	1,55
Softbank Group Corp. 5%	—	1,39
Grifols S.A. 3.875%	—	1,37
Teva Pharmaceutical Finance...	—	1,36
Softbank Group Corp. 5.25%	—	1,34
Adler Financing S.a r.l. 8.25%	—	1,13
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		24,90
Numero Complessivo di Titoli Azionari		5
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		234

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	10,18
Societario	98,07
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	5,22
Derivati	-13,47
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	15,71
Da 4 a 6 cedole	51,88
Da 6 a 8 cedole	19,59
Da 8 a 10 cedole	10,73
Da 10 a 12 cedole	1,99
Oltre 12 cedole	0,10

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	14,64
da 3 a 5	32,15
da 5 a 7	32,71
da 7 a 10	4,42
da 10 a 15	0,51
da 15 a 20	0,00
da 20 a 30	0,67
oltre 30	1,45

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	11,52 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	(08/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,41%
Data di Partenza	30/12/2008	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	1,41%
Nome del Gestore	Tim Leary	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
	Sid Chhabra	Inc/Acc	Inc		
	Tim van der Weyden	ISIN	LU0357317766		
Data Inizio Gestione	01/03/2022				
NAV (08/01/2026)	EUR 118,51				

BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund R - EUR (AIDiv)

Patrimonio Netto (Mln)	456,35 EUR
(30/11/2025)	