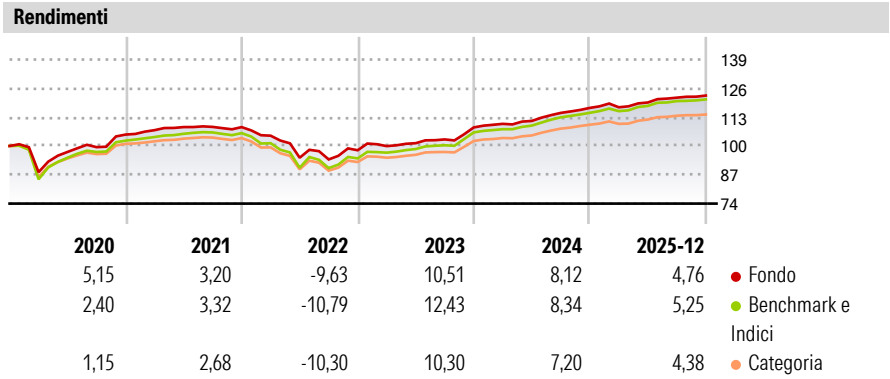


BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund B - EUR

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

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 | -1,00 | 3Y Sharpe Ratio | 1,47 |
| 3Y Beta | 1,04 | 3Y Std Dev | 3,14 |
| 3Y R-Squared | 96,34 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -1,43 | 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 Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|------|
| 3-Mesi | 1,43 | 1,52 | 1,12 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 2,64 | 2,37 | 1,99 | 2025 | 0,25 | 1,84 | 1,83 | 0,77 |
| 1-Anno | 5,32 | 5,80 | 4,93 | 2024 | 1,49 | 1,19 | 3,26 | 1,95 |
| 3-Anni Ann.ti | 7,02 | 7,86 | 6,78 | 2023 | 1,91 | 1,32 | 1,68 | 5,26 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,17 | 3,37 | 2,72 | 2022 | -3,57 | -9,50 | -0,81 | 4,41 |
| 10-Anni Ann.ti | 4,10 | 4,38 | 3,63 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 22/01/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|-------------------------|-------|------------------|------|------------------|-------|
| 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 Mar 26 | — | 15,10 |
| Euro Bobl Future Mar 26 | — | 2,35 |
| Sunrise Finco I B.V 4.625% | — | 1,89 |
| Fibercop S.p.A. 4.75% | — | 1,80 |
| Softbank Group Corp. 5% | — | 1,40 |
| Grifols S.A. 3.875% | — | 1,38 |
| Teva Pharmaceutical Finance... | — | 1,36 |
| Softbank Group Corp. 5.25% | — | 1,35 |
| Adler Financing S.a r.l. 8.25% | — | 1,14 |
| Pinnacle Bidco PLC 10% | — | 1,13 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 28,91 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 5 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 232 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|----------------------------------|--------|
| Governativo | 14,61 |
| Societario | 95,20 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 6,52 |
| Derivati | -16,33 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 14,17 |
| Da 4 a 6 cedole | 52,92 |
| Da 6 a 8 cedole | 19,92 |
| Da 8 a 10 cedole | 11,74 |
| Da 10 a 12 cedole | 1,14 |
| Oltre 12 cedole | 0,10 |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 13,52 |
| da 3 a 5 | 31,83 |
| da 5 a 7 | 30,94 |
| da 7 a 10 | 4,04 |
| da 10 a 15 | 0,50 |
| da 15 a 20 | 0,00 |
| da 20 a 30 | 0,65 |
| oltre 30 | 1,43 |

Anagrafica

| | | | | | |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 18,52 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | (22/01/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,86% |
| Data di Partenza | 03/09/2002 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,86% |
| Nome del Gestore | Tim Leary | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| | Sid Chhabra | Inc/Acc | Acc | | |
| | Tim van der Weyden | ISIN | LU0150855509 | | |
| Data Inizio Gestione | 01/03/2022 | | | | |
| NAV (22/01/2026) | EUR 493,84 | | | | |

BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund B - EUR

| | |
|------------------------|------------|
| Patrimonio Netto (Mln) | 455,49 EUR |
| (31/12/2025) | |