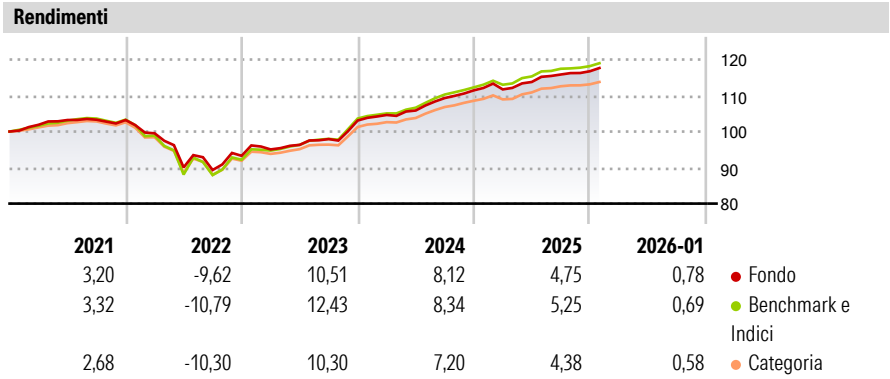


BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund M - EUR

<b>Categoria Morningstar™</b>	<b>Benchmark Morningstar</b>	<b>Benchmark Dichiarato</b>	<b>Morningstar Rating™</b>
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...



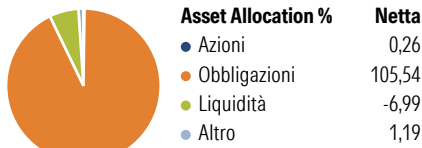
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-0,98	3Y Sharpe Ratio	1,40
3Y Beta	1,05	3Y Std Dev	2,78
3Y R-Squared	95,21	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,32	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	0,61	10Y Risk	-Med

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	1,38	1,07	Trimestrali %				
6-Mesi	2,08	1,87	1,55	2026	-	-	-	-
1-Anno	4,66	5,04	4,17	2025	0,24	1,85	1,82	0,77
3-Anni Ann.ti	6,66	7,45	6,40	2024	1,49	1,18	3,26	1,96
5-Anni Ann.ti	3,03	3,28	2,66	2023	1,91	1,32	1,68	5,26
10-Anni Ann.ti	4,30	4,59	3,82	2022	-3,57	-9,51	-0,81	4,41

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style	Fondo
Box™	
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	4,30
Qualità Credito Media	B

Qualità Credito

Alto  
Med  
Basso

Bassa  
Med  
Alta

Sensibilità ai Tassi

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
	0		0
AAA	0,00	BBB	2,86
AA	0,00	BB	48,33
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
Fibercomp 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)	6,19 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	(11/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,86%
Data di Partenza	14/02/2012	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	LU0438373382		
Data Inizio Gestione	01/03/2022				
NAV (11/02/2026)	EUR 184,56				

# BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund M - EUR

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