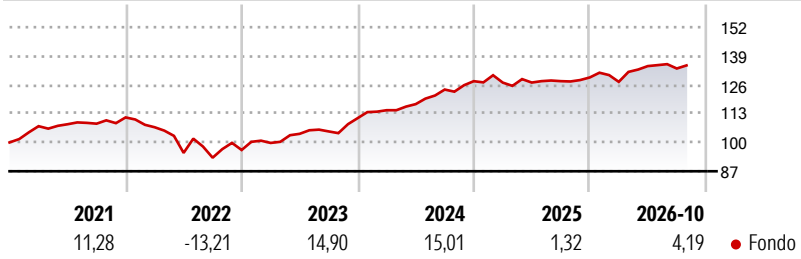
# BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund S - GBP (AIDiv)

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari Altro | Not Categorized<br>Usato nel Report | ICE BofA Euran Ccy HY Constnd TR HEUR | Senza rating |

## 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...

## Rendimenti




| 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 11,28 | -13,21 | 14,90 | 15,01 | 1,32 | 4,19 | ● Fondo |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 1,16 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 5,26 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo |
|---|---|
| 3-Mesi | 0,22 |
| 6-Mesi | 3,21 |
| 1-Anno | 7,00 |
| 3-Anni Ann.ti | 9,13 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,51 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 12/11/2026

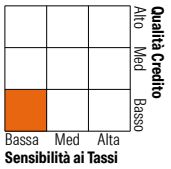
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -1,53 | 5,58 | -0,81 | - |
| 2025 | -0,50 | 0,01 | 0,51 | 1,31 |
| 2024 | 3,21 | 2,40 | 5,61 | 3,04 |
| 2023 | 3,32 | 4,12 | 1,04 | 5,72 |
| 2022 | -3,97 | -10,84 | -2,28 | 3,73 |

## Portafoglio 30/09/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,33 |
| Obbligazioni | 116,65 |
| Liquidità | -17,52 |
| Altro | 0,54 |

**Fixed Income Style Box™**




| | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 3,12 |
| Maturity effettiva | 4,22 |
| Qualità Credito Media | B |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 0,00 | BBB | 2,81 |
| AA | 0,00 | BB | 52,69 |
| A | 0,00 | B | 39,36 |
| | | Below B | 5,15 |
| | | Not Rated | 0,00 |

## Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| Euro Bobl Future Dec 26 | — | 4,69 |
| Rossini S.a.r.l. 6.75% | — | 1,94 |
| Fibercop S.p.A. 4.75% | — | 1,93 |
| Pinnacle Bidco PLC 10% | — | 1,71 |
| Softbank Group Corp. 5.25% | — | 1,62 |
| CD&R Firefly Bidco PLC 8.625% | — | 1,36 |
| Forvia SE 3% | — | 1,12 |
| Commerzbank AG 7.875% | — | 1,07 |
| GG12 S.p.A. 6.25% | — | 1,04 |
| Summer BidCo BV 0% | — | 1,04 |

| | |
|---|---|
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | 17,52 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | 4 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | 225 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 25,13 |
| Societario | 92,46 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | -1,27 |
| Derivati | -16,31 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 0,20 |
| Da 0 a 4 cedole | 10,89 |
| Da 4 a 6 cedole | 47,25 |
| Da 6 a 8 cedole | 27,49 |
| Da 8 a 10 cedole | 13,94 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,24 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 16,11 |
| da 3 a 5 | 32,28 |
| da 5 a 7 | 21,38 |
| da 7 a 10 | 3,40 |
| da 10 a 15 | 0,46 |
| da 15 a 20 | 0,00 |
| da 20 a 30 | 1,19 |
| oltre 30 | 0,66 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| Telefono | - |
| Web | www.bluebayinvest.com |
| Data di Partenza | 29/12/2015 |
| Nome del Gestore | Tim Leary<br>Sid Chhabra<br>Tim van der Weyden |
| Data Inizio Gestione | 01/03/2022 |
| NAV (12/11/2026) | GBP 102,10 |
| Patrimonio Classe (Mln) (12/11/2026) | 0,28 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | GBP |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Inc |
| ISIN | LU1291080965 |
| Investimento Min. Ingresso | - |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,66% |
| Spese correnti | 0,66% |
| Commissione di incentivo | - |

See disclosures for more details

© 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.

MORNINGSTAR

# BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund S - GBP (AIDiv)

| | |
|---|---|
| Patrimonio Netto (MIn) | 292,77 EUR |
| (30/09/2026) | |

See disclosures for more details

© 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.

MORNINGSTAR