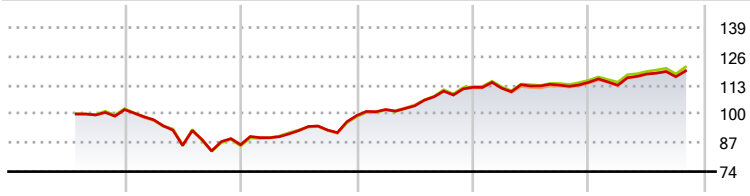
# BlueBay Funds - BlueBay Global High Yield ESG Bond Fund C-GBP (AIDiv)

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari High Yield Globali - GBP Hedged | Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged GBP<br>Usato nel Report | ICEBofAML Gbl HY IG Conty H TR USD | ★★★ |

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the ICE BofA Merrill Lynch Global High Yield Investment Grade Countries Index, fully hedged against USD, by investing in a global portfolio of fixed income securities while taking into account ESG considerations. There are no restrictions on the extent to which the Sub-Fund's portfolio and performance may deviate from the ones of the benchmark.

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | - | -15,55 | 15,31 | 12,83 | 2,03 | 4,41 |
| Benchmark e Indici | - | -16,43 | 15,51 | 13,60 | 2,59 | 5,21 |
| Categoria | - | -15,53 | 13,91 | 13,33 | 2,02 | 5,22 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -0,65 | 3Y Sharpe Ratio | 1,12 |
| 3Y Beta | 1,01 | 3Y Std Dev | 5,70 |
| 3Y R-Squared | 97,28 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,97 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 0,68 | 10Y Risk | - |

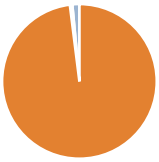
Basati su Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged GBP (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 0,16 | 0,84 | 0,64 |
| 6-Mesi | 2,45 | 3,13 | 3,03 |
| 1-Anno | 6,35 | 7,59 | 7,30 |
| 3-Anni Ann.ti | 8,77 | 9,51 | 9,23 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,70 | 3,94 | 3,72 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 10/11/2026

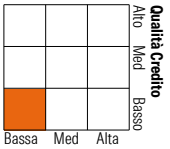
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -1,18 | 4,48 | -1,05 | - |
| 2025 | -0,39 | 0,90 | 0,35 | 1,16 |
| 2024 | 2,75 | 1,60 | 6,44 | 1,55 |
| 2023 | 3,68 | 3,57 | 0,29 | 7,08 |
| 2022 | -4,49 | -11,90 | -2,93 | 3,39 |

## Portafoglio 30/09/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 99,01 |
| Liquidità | -0,51 |
| Altro | 1,49 |

| Fixed Income Style Box™ | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 3,17 |
| Maturity effettiva | 4,16 |
| Qualità Credito Media | BB |




| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 0,00 | BBB | 2,13 |
| AA | 4,16 | BB | 56,70 |
| A | 0,00 | B | 32,40 |
| | | Below B | 4,46 |
| | | Not Rated | 0,15 |

## Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| 5 Year Treasury Note Future... | — | 3,49 |
| United States Treasury Notes... | — | 3,05 |
| CD&R Firefly Bidco PLC 8.625% | — | 1,29 |
| Sirius Xm Radio LLC 4% | — | 1,06 |
| OneMain Financial... | — | 1,05 |
| United States Treasury Notes... | — | 0,99 |
| US Foods Inc 4.75% | — | 0,91 |
| Deutsche Bank AG 6.75% | — | 0,88 |
| Paramount Skydance Corp.... | — | 0,84 |
| Ally Financial Inc. 7.1% | — | 0,83 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 14,40 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 1 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 220 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 7,53 |
| Societario | 92,97 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | -23,86 |
| Derivati | 23,35 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 0,39 |
| Da 0 a 4 cedole | 12,01 |
| Da 4 a 6 cedole | 22,22 |
| Da 6 a 8 cedole | 38,15 |
| Da 8 a 10 cedole | 24,77 |
| Da 10 a 12 cedole | 2,46 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 30,66 |
| da 3 a 5 | 25,07 |
| da 5 a 7 | 23,45 |
| da 7 a 10 | 7,85 |
| da 10 a 15 | 2,28 |
| da 15 a 20 | 0,39 |
| da 20 a 30 | 1,62 |
| oltre 30 | 1,55 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| Telefono | - |
| Web | www.bluebayinvest.com |
| Data di Partenza | 01/07/2021 |
| Nome del Gestore | Andrzej Skiba<br>Tim Leary<br>Tim van der Weyden |
| Data Inizio Gestione | 08/02/2017 |
| NAV (10/11/2026) | GBP 83,31 |
| Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2026) | 539,62 USD |
| Patrimonio Classe (Mln) (09/11/2026) | 0,24 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | GBP |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Inc |
| ISIN | LU2233263826 |
| Investimento Min. Ingresso | - |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,80% |
| Spese correnti | 0,80% |
| 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