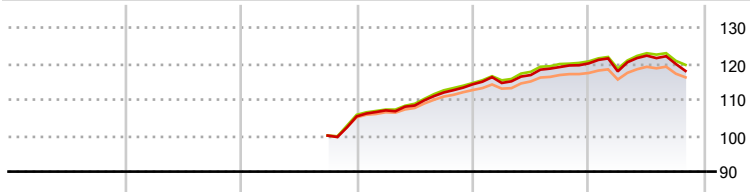
# BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund V - EUR

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari High Yield EUR | Morningstar Eurozone High-Yield Bond GR EUR<br>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...

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | - | - | - | 8,45 | 5,08 | -1,74 |
| Benchmark e Indici | - | - | - | 8,34 | 5,25 | -0,81 |
| Categoria | - | - | - | 7,20 | 4,38 | -0,97 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -0,64 | 3Y Sharpe Ratio | 0,79 |
| 3Y Beta | 1,07 | 3Y Std Dev | 3,91 |
| 3Y R-Squared | 97,33 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | -0,65 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 0,67 | 10Y Risk | - |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -2,25 | -1,77 | -1,63 |
| 6-Mesi | -1,27 | -0,47 | -0,39 |
| 1-Anno | -0,22 | 0,84 | 0,22 |
| 3-Anni Ann.ti | 5,93 | 6,20 | 5,29 |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 12/11/2026

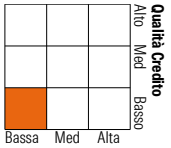
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -1,84 | 3,70 | -1,88 | - |
| 2025 | 0,32 | 1,92 | 1,90 | 0,85 |
| 2024 | 1,58 | 1,26 | 3,33 | 2,04 |
| 2023 | - | - | - | 5,33 |
| 2022 | - | - | - | - |

## 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 | 26/09/2023 |
| Nome del Gestore | Tim Leary<br>Sid Chhabra<br>Tim van der Weyden |
| Data Inizio Gestione | 01/03/2022 |
| NAV (12/11/2026) | EUR 119,25 |
| Patrimonio Classe (Mln) (11/11/2026) | 10,06 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU2668090421 |
| Investimento Min. Ingresso | - |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,55% |
| Spese correnti | 0,55% |
| 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 V - EUR

| | |
|---|---|
| Patrimonio Netto (Mln) | 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.