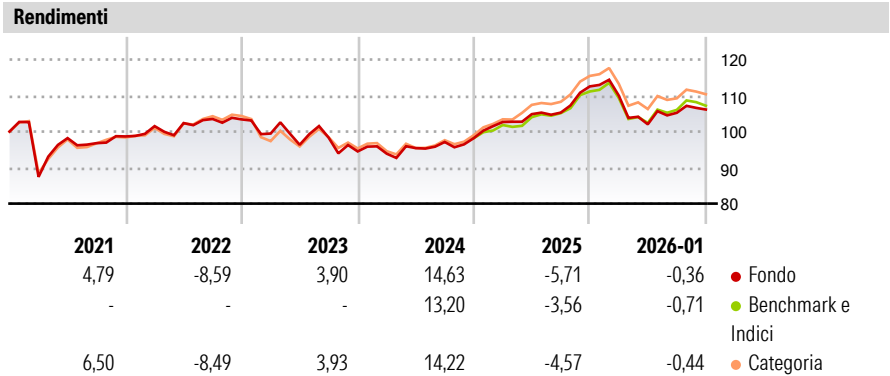


BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund R - USD

| | | | |
|--|--|------------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Obbligazionari Corporate Paesi Emergenti | Morningstar Emerging Markets Corporate Bond 10% China Capped GR USD <small>Usato nel Report</small> | JPM CEMBI Diversified TR USD | ★★★ |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Conseguire un rendimento totale superiore a quello dell'indice JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index (CEMBI) Diversified, investendo in un portafoglio costituito da titoli a reddito fisso di emittenti con sede in Paesi dei mercati emergenti. Il Comparto investe almeno due terzi del patrimonio netto in titoli a reddito fisso senza limiti di rating emessi da emittenti societari domiciliati in un Paese dei mercati emergenti, in titoli di debito privi di un rating e in titoli di debito emessi da società in difficoltà.



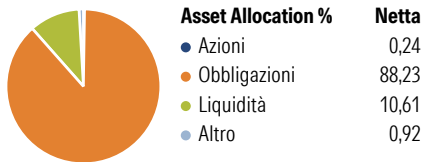
| Misure di Rischio | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | -0,29 | 3Y Sharpe Ratio | 0,08 |
| 3Y Beta | 0,84 | 3Y Std Dev | 6,53 |
| 3Y R-Squared | 90,65 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,44 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 1,52 | 10Y Risk | Med |

Basati su Morningstar Emerging Markets Corporate Bond 10% China Capped GR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|------|-------|
| 3-Mesi | -0,82 | -1,59 | -1,13 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 1,66 | 1,73 | 1,57 | 2025 | -2,27 | -7,26 | 3,15 | 0,86 |
| 1-Anno | -6,40 | -4,06 | -5,00 | 2024 | 4,56 | 2,13 | 0,41 | 6,91 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,47 | 4,08 | 3,55 | 2023 | -0,67 | 1,64 | 1,79 | 1,10 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,18 | 1,71 | 1,62 | 2022 | -3,80 | -3,14 | 2,05 | -3,88 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,89 | 4,06 | 3,55 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|-------------------------|-------|------------------|------|------------------|-------|
| Duration Effettiva | - | AAA | 0,00 | BBB | 29,85 |
| Maturity effettiva | 6,93 | AA | 3,04 | BB | 37,05 |
| Qualità Credito Media | BB | A | 7,03 | B | 19,48 |
| | | | | Below B | 3,56 |
| | | | | Not Rated | 0,00 |

| Titoli principali | | |
|---|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| 2 Year Treasury Note Future... | — | 6,15 |
| Digicel International... | — | 1,83 |
| Galaxy Pipeline Assets Bidco... | — | 1,82 |
| Banco Mercantil Del Norte SA... | — | 1,81 |
| Samarco Mineracao SA 9.5% | — | 1,78 |
| Ecopetrol S.A. 8.875% | — | 1,61 |
| Petroleos Mexicanos Sa De CV... | — | 1,31 |
| LATAM Airlines Group SA 7.875% | — | 1,28 |
| Antofagasta PLC 5.625% | — | 1,26 |
| First Abu Dhabi Bank P.J.S.C... | — | 1,15 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 20,00 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 3 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 201 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo | Scadenze % | Fondo |
|----------------------------------|-------|------------|-------|
| Governativo | 7,80 | da 1 a 3 | 11,15 |
| Societario | 90,33 | da 3 a 5 | 24,68 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 | da 5 a 7 | 21,16 |
| Enti Locali | 0,00 | da 7 a 10 | 16,75 |
| Liquidità ed equivalenti | 7,44 | da 10 a 15 | 7,49 |
| Derivati | -5,57 | da 15 a 20 | 2,48 |
| | | da 20 a 30 | 7,78 |
| | | oltre 30 | 0,34 |
| Coupon Range % | Fondo | | |
| 0 coupon | 0,86 | | |
| Da 0 a 4 cedole | 9,11 | | |
| Da 4 a 6 cedole | 22,80 | | |
| Da 6 a 8 cedole | 36,70 | | |
| Da 8 a 10 cedole | 29,48 | | |
| Da 10 a 12 cedole | 0,71 | | |
| Oltre 12 cedole | 0,32 | | |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 14,62 USD | Investimento Min. Ingresso | 500.000 EUR |
| Telefono | - | (03/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 1,70% |
| Data di Partenza | 31/03/2008 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 1,70% |
| Nome del Gestore | Polina Kurdyavko | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| | Anthony Kettle | Inc/Acc | Acc | | |
| Data Inizio Gestione | 31/03/2008 | ISIN | LU0356217504 | | |
| NAV (03/02/2026) | USD 234,13 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 134,54 USD | | | | |

(31/12/2025)