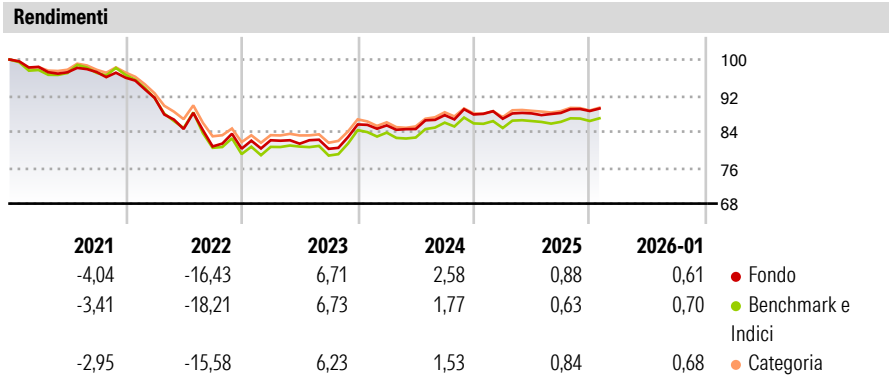


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund B EUR Acc

| | | | |
|--------------------------------|---|------------------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Obbligazionari Governativi EUR | Morningstar Eurozone Treasury Bond GR EUR Usato nel Report | Bloomberg Euro Agg Treasury TR EUR | ★★★★ |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il Fondo si prefigge di conseguire per voi un rendimento combinando la generazione di reddito con la crescita del capitale da voi investito. Investe prevalentemente in obbligazioni che pagano un tasso di interesse fisso. Il Fondo mira a conseguire rendimenti migliori di quelli del suo indice di riferimento, che è il Barclays Capital Euro Aggregate Treasury Index. L'investimento del Fondo può allontanarsi in misura considerevole da tale indice, laddove giustificato dalle condizioni di mercato. Almeno due terzi degli investimenti del Fondo saranno effettuati in obbligazioni a tasso fisso che abbiano ottenuto un rating investment grade, emesse da governi, banche e società aventi sede nei paesi dell'Unione europea e il cui debito pubblico...



| Misure di Rischio | | | |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | 0,24 | 3Y Sharpe Ratio | -0,02 |
| 3Y Beta | 0,93 | 3Y Std Dev | 4,65 |
| 3Y R-Squared | 94,70 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | 0,25 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 1,12 | 10Y Risk | +Med |

Basati su Morningstar Eurozone Treasury Bond GR EUR (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 0,58 | 0,34 | 0,38 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 1,77 | 1,26 | 1,18 | 2025 | -1,08 | 1,36 | 0,12 | 0,49 |
| 1-Anno | 1,40 | 1,52 | 1,44 | 2024 | -0,25 | -0,95 | 3,65 | 0,17 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,01 | 2,78 | 2,56 | 2023 | 2,33 | -0,93 | -1,40 | 6,76 |
| 5-Anni Ann.ti | -2,16 | -2,55 | -2,10 | 2022 | -4,67 | -7,55 | -4,58 | -0,62 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,13 | 0,05 | -0,23 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 31/12/2025

| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|--------|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 212,82 |
| Liquidità | -112,8 |
| Altro | 2 |
| | 0,00 |

Fixed Income Style Box™

Duration Effettiva: -
Maturity effettiva: 10,15
Qualità Credito Media: A

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta

Credit Quality %

| Fond | Credit Quality % | Fond | |
|------|------------------|-----------|-------|
| 0 | 0 | 0 | |
| AAA | 23,25 | BBB | 25,70 |
| AA | 10,67 | BB | 0,00 |
| A | 40,39 | B | 0,00 |
| | | Below B | 0,00 |
| | | Not Rated | 0,00 |

| Titoli principali | | |
|---|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| Euro Schatz Future Mar 26 | — | 6,80 |
| Germany (Federal Republic... | — | 6,69 |
| Italy (Republic Of) 0.6% | — | 5,72 |
| Euro OAT Future Mar 26 | — | 5,12 |
| France (Republic Of) 3% | — | 4,30 |
| Spain (Kingdom of) 0% | — | 3,47 |
| Italy (Republic Of) 2.95% | — | 3,30 |
| France (Republic Of) 2.5% | — | 3,17 |
| Spain (Kingdom of) 0.7% | — | 3,11 |
| Euro Bobl Future Mar 26 | — | 2,64 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 44,32 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 122 |

| Fixed Income Sector Weightings % | | Fondo |
|----------------------------------|--|--------|
| Governativo | | 215,14 |
| Societario | | 0,00 |
| Cartolarizzazioni | | 0,00 |
| Enti Locali | | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | | -93,62 |
| Derivati | | -21,52 |
| Coupon Range % | | Fondo |
| 0 coupon | | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | | 0,00 |
| Da 4 a 6 cedole | | 0,00 |
| Da 6 a 8 cedole | | 0,00 |
| Da 8 a 10 cedole | | 0,00 |
| Da 10 a 12 cedole | | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | | 0,00 |

| Scadenze % | | Fondo |
|------------|--|-------|
| da 1 a 3 | | 52,13 |
| da 3 a 5 | | 8,45 |
| da 5 a 7 | | 5,62 |
| da 7 a 10 | | 13,48 |
| da 10 a 15 | | 2,38 |
| da 15 a 20 | | 1,46 |
| da 20 a 30 | | 6,48 |
| oltre 30 | | 1,48 |

| Anagrafica | | | | | |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 6,06 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | (11/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,70% |
| Data di Partenza | 20/01/2011 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,70% |
| Nome del Gestore | Mark Dowding | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| | Kaspar Hense | Inc/Acc | Acc | | |
| | Sheraz Hussain | ISIN | LU0549536745 | | |
| Data Inizio Gestione | 01/12/2017 | | | | |
| NAV (11/02/2026) | EUR 169,49 | | | | |

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund B EUR Acc

| | |
|------------------------|--------------|
| Patrimonio Netto (Mln) | 4.094,18 EUR |
| (31/12/2025) | |