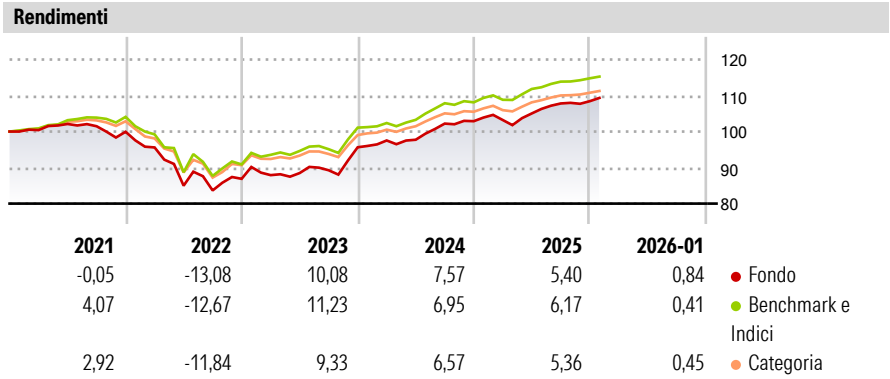


BlueBay Funds - BlueBay Global High Yield Bond Fund C - EUR (AIDiv)

|  |   |                                 |                            |
|--|---|---------------------------------|----------------------------|
| <b>Categoria Morningstar™</b>                  | <b>Benchmark Morningstar</b>                                      | <b>Benchmark Dichiarato</b>     | <b>Morningstar Rating™</b> |
| Obbligazionari Globali High Yield - EUR Hedged | Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged EUR Usato nel Report | ICE BofA Gbl HY Constnd TR HUSD | ★★★★                       |

**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 obbligazioni di società con rating investment grade. Almeno il 50% del patrimonio netto del Comparto viene investito in titoli emessi da entità domiciliate negli Stati Uniti. Il Comparto può inoltre investire (i) fino al 10% del patrimonio netto in titoli emessi da entità domiciliate in America latina (Messico, America centrale, Sud America e isole dei Caraibi, ivi compreso Porto Rico); e (ii) fino al 10% del patrimonio netto in titoli emessi da entità domiciliate in Asia (continente asiatico e isole...



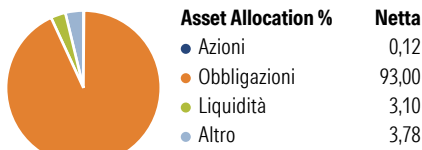
| Misure di Rischio |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | -0,90 | 3Y Sharpe Ratio | 0,78 |
| 3Y Beta           | 1,15  | 3Y Std Dev      | 4,64 |
| 3Y R-Squared      | 89,52 | 3Y Risk         | Alto |
| 3Y Info Ratio     | -0,23 | 5Y Risk         | +Med |
| 3Y Tracking Error | 1,60  | 10Y Risk        | Med  |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat  | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2     | Q3    | Q4   |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|--------|-------|------|
| 3-Mesi           | 1,42  | 1,40 | 1,21 | 2026                     | -     | -      | -     | -    |
| 6-Mesi           | 3,17  | 2,86 | 2,48 | 2025                     | 0,32  | 1,76   | 2,64  | 0,58 |
| 1-Anno           | 5,49  | 5,64 | 5,04 | 2024                     | 1,98  | 0,21   | 4,59  | 0,65 |
| 3-Anni Ann.ti    | 6,26  | 6,63 | 5,84 | 2023                     | 1,18  | 0,65   | 0,87  | 7,16 |
| 5-Anni Ann.ti    | 1,72  | 2,73 | 2,06 | 2022                     | -4,36 | -11,11 | -1,55 | 3,85 |
| 10-Anni Ann.ti   | 3,57  | 4,63 | 3,38 |                          |       |        |       |      |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Portafoglio 30/11/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond  |
|-------------------------|-------|------------------|------|------------------|-------|
| Duration Effettiva      | -     | AAA              | 0,00 | BBB              | 4,81  |
| Maturity effettiva      | 5,53  | AA               | 0,00 | BB               | 49,64 |
| Qualità Credito Media   | B     | A                | 0,00 | B                | 33,03 |
|                         |       |                  |      | Below B          | 12,45 |
|                         |       |                  |      | Not Rated        | 0,06  |

| Titoli principali                           |         |      |
|---|---------|------|
| Nome  | Settore | %    |
| Softbank Group Corp. 8.25%                  | —       | 1,33 |
| Sunoco Lp/Sunoco Fin 144A...                | —       | 1,01 |
| Yinson Bergenia Production...               | —       | 0,99 |
| Nissan Motor Acceptance Co...               | —       | 0,84 |
| Apld Computeco LLC 9.25%                    | —       | 0,83 |
| Vital Energy Inc 7.875%                     | —       | 0,82 |
| Petroleos Mexicanos Sa De CV...             | —       | 0,77 |
| Paramount Global 6.375%                     | —       | 0,77 |
| Discovery Communications,...                | —       | 0,75 |
| Commerzbank AG 7.875%                       | —       | 0,74 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 8,87 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 2    |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 236  |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo  |
|----------------------------------|--------|
| Governativo                      | 0,00   |
| Societario                       | 97,33  |
| Cartolarizzazioni                | 0,00   |
| Enti Locali                      | 0,00   |
| Liquidità ed equivalenti         | -26,16 |
| Derivati                         | 28,83  |
| Coupon Range %                   | Fondo  |
| 0 coupon                         | 0,00   |
| Da 0 a 4 cedole                  | 3,83   |
| Da 4 a 6 cedole                  | 14,03  |
| Da 6 a 8 cedole                  | 44,62  |
| Da 8 a 10 cedole                 | 33,35  |
| Da 10 a 12 cedole                | 3,01   |
| Oltre 12 cedole                  | 1,16   |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 13,10 |
| da 3 a 5   | 27,81 |
| da 5 a 7   | 28,88 |
| da 7 a 10  | 15,37 |
| da 10 a 15 | 2,08  |
| da 15 a 20 | 2,18  |
| da 20 a 30 | 4,75  |
| oltre 30   | 5,39  |

Anagrafica

|                      |                                       |                         |              |                              |       |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione  | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 14,61 EUR    | Investimento Min. Ingresso   | -     |
| Telefono             | -                                     | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -     |
| Web                  | www.bluebayinvest.com                 | Valuta del Fondo        | EUR          | T.E.R.                       | 0,80% |
| Data di Partenza     | 08/12/2015                            | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 0,80% |
| Nome del Gestore     | Andrzej Skiba                         | Inc/Acc                 | Inc          | Commissione di incentivo     | -     |
|                      | Tim Leary                             | ISIN                    | LU0842205584 |                              |       |
|                      | Tim van der Weyden                    |                         |              |                              |       |
| Data Inizio Gestione | 01/01/2018                            |                         |              |                              |       |
| NAV (03/02/2026)     | EUR 76,46                             |                         |              |                              |       |

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

|                        |              |
|------------------------|--------------|
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.719,65 USD |
| (30/11/2025)           |              |