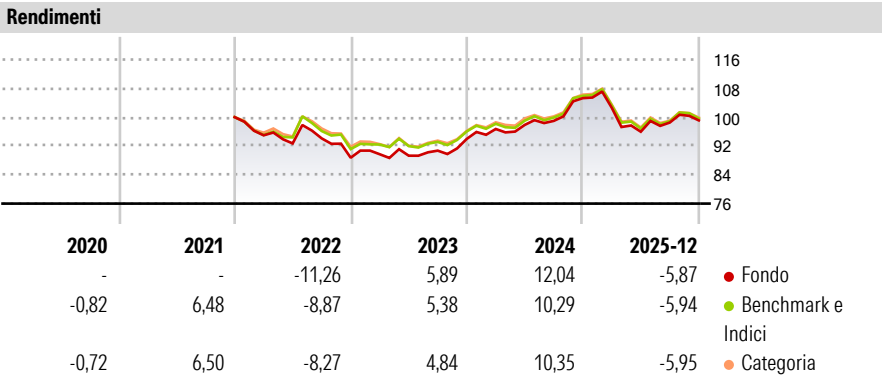


BlueBay Funds - BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund R - USD

|                                    |  |  |                            |
|------------------------------------|--|--|----------------------------|
| <b>Categoria Morningstar™</b>      | <b>Benchmark Morningstar</b>   | <b>Benchmark Dichiarato</b>            | <b>Morningstar Rating™</b> |
| Global Corporate Bond - USD Hedged | Morningstar Global Corporate Bond GR<br>Hedged USD<br>Usato nel Report | Bloomberg Gbl Agg Corp 0901 TR Hdg USD | ★★★★                       |

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

Conseguire un rendimento totale superiore a quello dell'indice Barclays Global Aggregate Corporates Bond Index, con copertura USD, investendo in un portafoglio di titoli a reddito fisso con rating investment grade. Il Comparto investe almeno il 65% del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating investment grade.



| Misure di Rischio |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 0,71  | 3Y Sharpe Ratio | 0,14 |
| 3Y Beta           | 1,01  | 3Y Std Dev      | 6,76 |
| 3Y R-Squared      | 96,58 | 3Y Risk         | +Med |
| 3Y Info Ratio     | 0,72  | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | 1,06  | 10Y Risk        | -    |

Basati su Morningstar Global Corporate Bond GR Hedged USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3   | Q4    |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|------|-------|
| 3-Mesi           | -1,90 | -2,35 | -2,19 | 2026                     | -     | -     | -    | -     |
| 6-Mesi           | -0,22 | -0,70 | -0,45 | 2025                     | -2,54 | -6,47 | 2,65 | 0,61  |
| 1-Anno           | -6,60 | -6,82 | -6,53 | 2024                     | 2,93  | 1,17  | 1,14 | 6,37  |
| 3-Anni Ann.ti    | 2,61  | 2,22  | 2,37  | 2023                     | 1,09  | -0,45 | 1,57 | 3,59  |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | 1,08  | 1,31  | 2022                     | -5,04 | -2,37 | 1,52 | -5,71 |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | 2,24  | 2,28  |                          |       |       |      |       |

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

**Portafoglio 31/12/2025**

| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni             | 0,00  |
| Obbligazioni       | 64,75 |
| Liquidità          | 34,63 |
| Altro              | 0,62  |

**Fixed Income Style Box™**

|       |  |  |  |
|-------|--|--|--|
| Alto  |  |  |  |
| Med   |  |  |  |
| Basso |  |  |  |

Qualità Credito  
Sensibilità ai Tassi

**Credit Quality %**

| Fond | Credit Quality % | Fond      |       |
|------|------------------|-----------|-------|
| 0    | 0                | 0         |       |
| AAA  | 0,00             | BBB       | 76,90 |
| AA   | 0,00             | BB        | 14,21 |
| A    | 8,85             | B         | 0,00  |
|      |                  | Below B   | 0,00  |
|      |                  | Not Rated | 0,03  |

| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| 5 Year Treasury Note Future...              | —       | 6,27  |
| US Treasury Bond Future Mar 26              | —       | 4,83  |
| Euro Schatz Future Mar 26                   | —       | 4,61  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 2,01  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 2,00  |
| 10 Year Government of Canada...             | —       | 1,52  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 1,50  |
| United States Treasury Notes...             | —       | 1,50  |
| Ultra US Treasury Bond...                   | —       | 1,14  |
| Ford Motor Credit Company...                | —       | 1,03  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 26,43 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 243   |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|----------------------------------|-------|
| ■ Governativo                    | 10,63 |
| ■ Societario                     | 86,29 |
| ■ Cartolarizzazioni              | 0,34  |
| ■ Enti Locali                    | 0,00  |
| ■ Liquidità ed equivalenti       | 7,75  |
| ■ Derivati                       | -5,00 |
| Coupon Range %                   | Fondo |
| 0 coupon                         | 0,00  |
| Da 0 a 4 cedole                  | 23,54 |
| Da 4 a 6 cedole                  | 42,67 |
| Da 6 a 8 cedole                  | 31,81 |
| Da 8 a 10 cedole                 | 1,98  |
| Da 10 a 12 cedole                | 0,00  |
| Oltre 12 cedole                  | 0,00  |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 26,47 |
| da 3 a 5   | 7,61  |
| da 5 a 7   | 9,40  |
| da 7 a 10  | 15,01 |
| da 10 a 15 | 9,63  |
| da 15 a 20 | 0,82  |
| da 20 a 30 | 8,37  |
| oltre 30   | 3,68  |

| Anagrafica           |                                       |                         |              |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|
| Società di Gestione  | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 14,87 USD    |
| Telefono             | -                                     | (29/01/2026)            |              |
| Web                  | www.bluebayinvest.com                 | Domicilio               | LUSSEMBURGO  |
| Data di Partenza     | 18/06/2014                            | Valuta del Fondo        | USD          |
| Nome del Gestore     | Andrzej Skiba                         | UCITS                   | Si           |
|                      | Marc Stacey                           | Inc/Acc                 | Acc          |
|                      | Thomas Moulds                         | ISIN                    | LU0847091310 |
|                      | Neil Sun                              |                         |              |
| Data Inizio Gestione | 22/10/2012                            |                         |              |
| NAV (29/01/2026)     | USD 103,10                            |                         |              |

# BlueBay Funds - BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund R - USD

Patrimonio Netto (Mln) 2.087,31 USD

(31/12/2025)