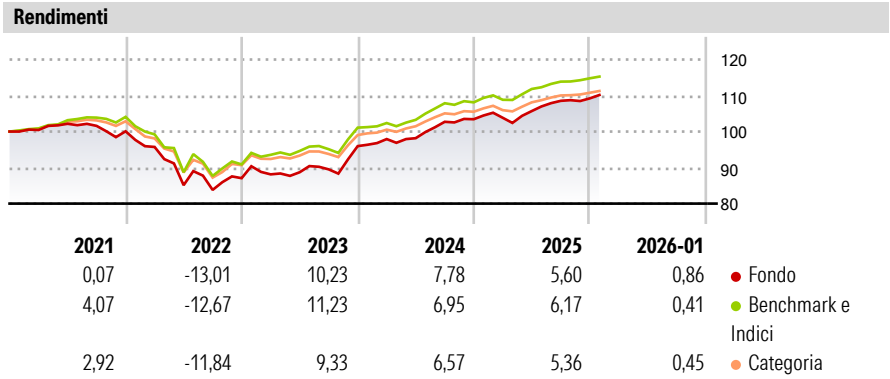


BlueBay Funds - BlueBay Global High Yield Bond Fund S - EUR

| | | | |
|---|---|---------------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| 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...



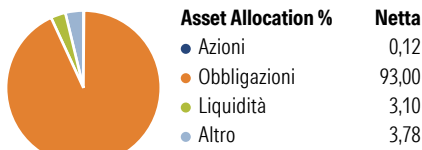
| Misure di Rischio | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | -0,73 | 3Y Sharpe Ratio | 0,82 |
| 3Y Beta | 1,15 | 3Y Std Dev | 4,64 |
| 3Y R-Squared | 89,53 | 3Y Risk | Alto |
| 3Y Info Ratio | -0,11 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 1,60 | 10Y Risk | Med |

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 | 1,47 | 1,40 | 1,21 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 3,27 | 2,86 | 2,48 | 2025 | 0,38 | 1,80 | 2,69 | 0,63 |
| 1-Anno | 5,71 | 5,64 | 5,04 | 2024 | 2,03 | 0,25 | 4,64 | 0,69 |
| 3-Anni Ann.ti | 6,45 | 6,63 | 5,84 | 2023 | 1,22 | 0,67 | 0,90 | 7,21 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,86 | 2,73 | 2,06 | 2022 | -4,34 | -11,09 | -1,54 | 3,88 |
| 10-Anni Ann.ti | 3,78 | 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) | 245,27 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | 0,60% |
| Data di Partenza | 31/07/2014 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,60% |
| Nome del Gestore | Andrzej Skiba | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| | Tim Leary | ISIN | LU0995159539 | | |
| | Tim van der Weyden | | | | |
| Data Inizio Gestione | 01/01/2018 | | | | |
| NAV (03/02/2026) | EUR 141,36 | | | | |

BlueBay Funds - BlueBay Global High Yield Bond Fund S - EUR

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