

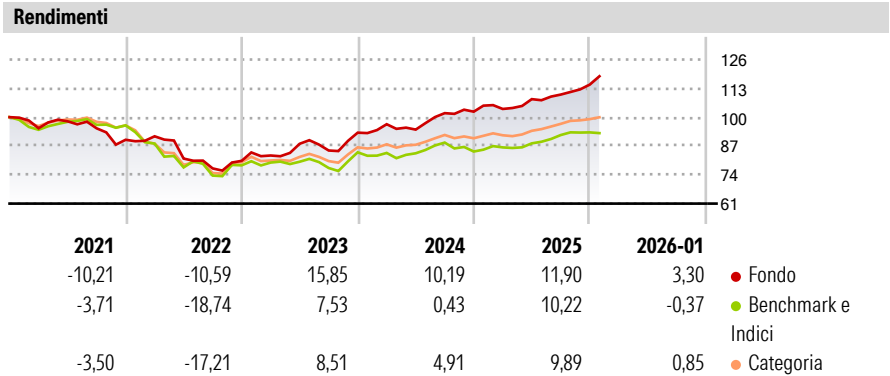
BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund G - EUR (Perf)

| | | | |
|------------------------------------|---|-----------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Obbligazionari Paesi Emergenti EUR | Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged EUR Usato nel Report | No benchmark | ★★★★★ |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Conseguire un rendimento assoluto facendo ricorso a una strategia basata su una combinazione di posizioni long e short (tramite l'utilizzo di strumenti finanziari derivati) in un portafoglio di titoli a reddito fisso prevalentemente di Emittenti dei paesi emergenti distribuiti e denominati in qualsiasi valuta, oltre che in titoli legati, direttamente o indirettamente, a valute e/o tassi d'interesse di Paesi dei mercati emergenti.

| Misure di Rischio | | | |
|--|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 7,14 | 3Y Sharpe Ratio | 1,26 |
| 3Y Beta | 0,74 | 3Y Std Dev | 6,97 |
| 3Y R-Squared | 56,49 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | 1,43 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 4,96 | 10Y Risk | - |
| Basati su Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged EUR (dove applicabile) | | | |



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|------|--------|-------|------|
| 3-Mesi | 6,36 | -0,24 | 2,15 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 9,87 | 4,22 | 6,33 | 2025 | 1,19 | 4,27 | 1,91 | 4,07 |
| 1-Anno | 12,81 | 8,88 | 10,33 | 2024 | 4,09 | -2,50 | 7,86 | 0,66 |
| 3-Anni Ann.ti | 12,27 | 4,58 | 6,88 | 2023 | 3,00 | 6,40 | -3,45 | 9,48 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,30 | -1,23 | 0,42 | 2022 | 1,75 | -10,99 | -5,47 | 4,43 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

| Portafoglio 30/11/2025 | | | | Fixed Income Style | | | | Credit Quality % | | | |
|---------------------------|--|--|--|-----------------------|--|--|--|------------------|--|--|--|
| | | | | Box™ | | | | Fond | | | |
| Asset Allocation % | | | | Duration Effettiva | | | | 0 | | | |
| ● Azioni | | | | Maturità effettiva | | | | 0 | | | |
| ● Obbligazioni | | | | Qualità Credito Media | | | | | | | |
| ● Liquidità | | | | Qualità Credito | | | | | | | |
| ● Altro | | | | Sensibilità ai Tassi | | | | | | | |
| Netta | | | | | | | | | | | |
| 0,00 | | | | | | | | | | | |
| 111,87 | | | | | | | | | | | |
| -13,80 | | | | | | | | | | | |
| 1,93 | | | | | | | | | | | |

| Titoli principali | | |
|---|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| Colombia (Republic Of) 7.75% | — | 3,99 |
| Colombia (Republic Of) 13.25% | — | 3,97 |
| Buenos Aires (Province Of)... | — | 3,97 |
| Ecuador (Republic Of) 6.9% | — | 3,41 |
| Bogota, Distrito Capital... | — | 3,07 |
| Turkey (Republic of) 6.8% | — | 3,01 |
| Argentina (Republic Of) 4.125% | — | 3,01 |
| Indonesia (Republic of) 7.125% | — | 2,62 |
| Zambia (Republic Of) 5.75% | — | 2,43 |
| Central Bank Of Tunisie SA... | — | 2,28 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 31,77 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 126 |

| Fixed Income Sector Weightings % | | Fondo |
|----------------------------------|--|--------|
| ■ Governativo | | 114,17 |
| ■ Societario | | 16,51 |
| ■ Cartolarizzazioni | | 0,00 |
| ■ Enti Locali | | 0,00 |
| ■ Liquidità ed equivalenti | | -37,90 |
| ■ Derivati | | 7,21 |
| Coupon Range % | | Fondo |
| 0 coupon | | 7,33 |
| Da 0 a 4 cedole | | 1,28 |
| Da 4 a 6 cedole | | 8,89 |
| Da 6 a 8 cedole | | 39,70 |
| Da 8 a 10 cedole | | 22,60 |
| Da 10 a 12 cedole | | 7,41 |
| Oltre 12 cedole | | 12,79 |

| Scadenze % | | Fondo |
|------------|--|-------|
| da 1 a 3 | | 14,18 |
| da 3 a 5 | | 23,96 |
| da 5 a 7 | | 6,79 |
| da 7 a 10 | | 20,25 |
| da 10 a 15 | | 16,85 |
| da 15 a 20 | | 1,28 |
| da 20 a 30 | | 7,14 |
| oltre 30 | | 1,07 |

| Anagrafica | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 247,25 EUR |
| Telefono | - | (03/02/2026) | |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Data di Partenza | 01/08/2016 | Valuta del Fondo | EUR |
| Nome del Gestore | Polina Kurdyavko | UCITS | Si |
| | Anthony Kettle | Inc/Acc | Acc |
| | Brent David | ISIN | LU1444358938 |
| Data Inizio Gestione | 01/06/2016 | | |
| NAV (03/02/2026) | EUR 153,28 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 870,73 USD | | |
| (30/11/2025) | | | |