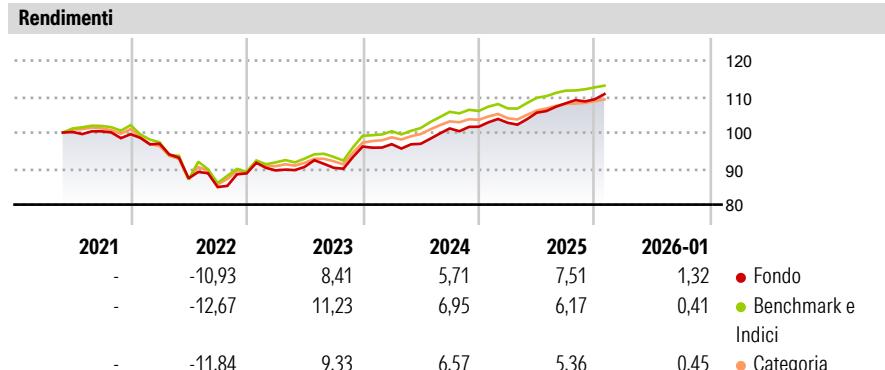


BlueBay Structured Funds - Total Return Diversified Credit H EUR

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|--|----------------------|---------------------|
| Obbligazionari Globali High Yield - EUR Hedged | Morningstar Global High-Yield Bond GR Hedged EUR <small>Usato nel Report</small> | N/A | Senza rating |

Obiettivo d'Investimento Dichiарато

To achieve a total return from investments in higher yielding fixed income asset classes through active security selection, asset allocation and capital preservation techniques. The Sub-Fund invests its net assets predominately in fixed income securities from issuers globally (including Emerging Market Issuers). The Sub-Fund may invest in fixed income securities of any rating, in unrated debt securities and in Distressed Debt Securities. The Sub-Fund may invest up to 25% of its net assets in convertible bonds, warrant-linked bonds and similar convertible instruments issued by domestic or international issuers. The Sub-Fund may invest up to 50% of its net assets in loans.



Misure di Rischio

| Misure di Rischio | | | | |
|-------------------|-------|-----------------|------|--|
| 3Y Alpha | -0,40 | 3Y Sharpe Ratio | 0,83 | |
| 3Y Beta | 0,99 | 3Y Std Dev | 4,14 | |
| 3Y R-Squared | 81,60 | 3Y Risk | - | |
| 3Y Info Ratio | -0,28 | 5Y Risk | - | |
| 3Y Tracking Error | 1,77 | 10Y Risk | - | |

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

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | C |
|------------------|-------|------|----|
| 3-Mesi | 1,57 | 1,40 | 1, |
| 6-Mesi | 4,42 | 2,86 | 2, |
| 1-Anno | 7,79 | 5,64 | 5, |
| 3-Anni Ann.ti | 6,28 | 6,63 | 5, |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|-----------------------------|-------|-------|-------|------|
| 2026 | - | - | - | - |
| 2025 | 1,08 | 2,72 | 2,49 | 1,03 |
| 2024 | 0,67 | 0,11 | 4,39 | 0,47 |
| 2023 | 0,92 | 1,11 | -0,28 | 6,53 |
| 2022 | -2,65 | -9,91 | -2,77 | 4,46 |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond 0 | Credit Quality % | Fond 0 |
|-----------------------------|-----------------------|------------------|--------|------------------|--------|
| | Duration Effettiva | - | | | |
| | Maturity effettiva | 8,16 | | | |
| | Qualità Credito Media | BB | AAA | 1,43 | BBB |
| | | | AA | 1,57 | BB |
| | | | A | 4,27 | B |
| | | | | Below B | 4,76 |
| | | | | Not Rated | 0,25 |
| Bassa | Med | Alta | | | |
| Sensibilità ai Tassi | | | | | |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|--|---------|--------------|
| 2 Year Treasury Note Future... | — | 19,09 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. 5,875% | — | 1,31 |
| Credit Agricole S.A. 6,5% | — | 1,02 |
| Barclays PLC 8,875% | — | 0,98 |
| Commerzbank AG 6,5% | — | 0,79 |
| KBC Group NV 6,25% | — | 0,78 |
| BNP Paribas SA 7,75% | — | 0,76 |
| Deutsche Bank AG 10% | — | 0,76 |
| Banco Bilbao Vizcaya... | — | 0,73 |
| Banco Santander SA 9,625% | — | 0,71 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 26,93 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 2 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 437 |

| Fixed Income Sector Weightings % | | Fondi |
|--|-------|--------------|
|  Governativo | 46,6 | |
|  Societario | 58,9 | |
|  Cartolarizzazioni | 13,0 | |
|  Enti Locali | 0,0 | |
|  Liquidità ed equivalenti | -65,7 | |
|  Derivati | 46,6 | |

| Coupon Range % | | Fondi |
|-----------------------|------|--------------|
| 0 coupon | 6,4 | |
| Da 0 a 4 cedole | 6,4 | |
| Da 4 a 6 cedole | 23,7 | |
| Da 6 a 8 cedole | 37,7 | |
| Da 8 a 10 cedole | 21,0 | |
| Da 10 a 12 cedole | 2,2 | |
| Ulta 12 cedole | 1,1 | |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 14,38 |
| da 3 a 5 | 19,06 |
| da 5 a 7 | 17,91 |
| da 7 a 10 | 10,96 |
| da 10 a 15 | 12,84 |
| da 15 a 20 | 1,92 |
| da 20 a 30 | 3,79 |
| oltre 30 | 113 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|--|---|--------------|--|------------------------------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) (03/02/2026) | 112,45 EUR | Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo | 1.000.000 EUR 500.000 EUR |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,90% |
| Web | www.bluebayinvest.com | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | - |
| Data di Partenza | 05/05/2021 | UCITS | No | Commissione di incentivo | - |
| Nome del Gestore | Not Disclosed | Inc/Acc | Acc | | |
| Data Inizio Gestione | 01/01/2021 | ISIN | LU2308615017 | | |
| NAV (03/02/2026) | EUR 111,07 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.294,12 USD | | | | |
| (31/12/2025) | | | | | |