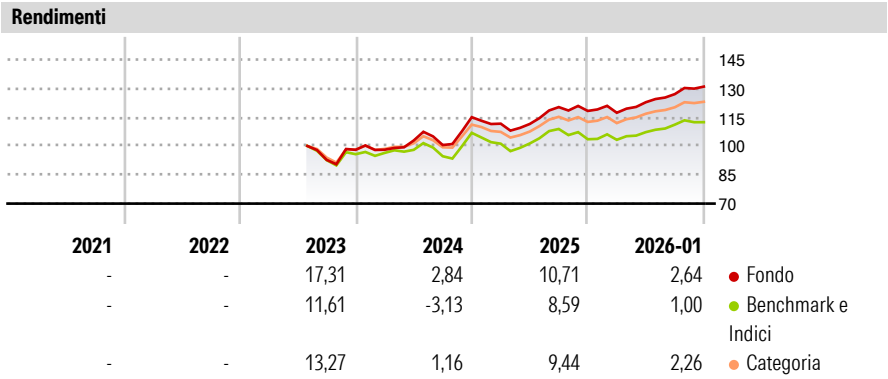


BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Bond Fund - Q - CHF accumulating

|                               |   |                                    |                            |
|-------------------------------|---|------------------------------------|----------------------------|
| <b>Categoria Morningstar™</b> | <b>Benchmark Morningstar</b>  | <b>Benchmark Dichiarato</b>        | <b>Morningstar Rating™</b> |
| Category_EUCA001034           | Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged CHF<br>Usato nel Report | JPM EMBI Global Diversified TR USD | ★★★★                       |

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

Conseguire un tasso di rendimento totale superiore a quello dell'indice JP Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified, investendo in un portafoglio di titoli a reddito fisso di emittenti con sede in Paesi dei mercati emergenti. Il Comparto investe almeno due terzi del patrimonio netto in titoli a reddito fisso senza limiti di rating emessi da Emittenti dei mercati emergenti. Il Comparto investe in titoli denominati in USD e in valute diverse dall'USD, ivi compresi i titoli denominati nelle Valute locali dei Paesi dei mercati emergenti in cui il Comparto stesso investe. La percentuale dei titoli denominati in valute diverse dall'USD può aumentare nel tempo, in linea con le opportunità offerte dal mercato e con eventuali...



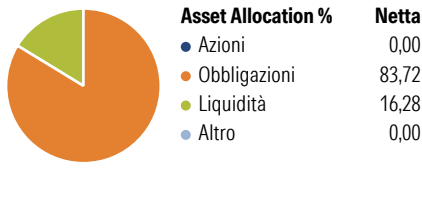
| Misure di Rischio |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 4,72  | 3Y Sharpe Ratio | 0,83 |
| 3Y Beta           | 0,86  | 3Y Std Dev      | 8,63 |
| 3Y R-Squared      | 85,10 | 3Y Risk         | Med  |
| 3Y Info Ratio     | 1,72  | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | 2,73  | 10Y Risk        | -    |

Basati su Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged CHF (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk  | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 3,87  | 0,86 | 3,22  | 2026                     | -     | -     | -     | -     |
| 6-Mesi           | 8,42  | 4,71 | 7,18  | 2025                     | -0,79 | 4,66  | 3,44  | 3,08  |
| 1-Anno           | 12,65 | 9,03 | 11,36 | 2024                     | -2,92 | -0,14 | 7,89  | -1,67 |
| 3-Anni Ann.ti    | 10,20 | 5,10 | 7,84  | 2023                     | 0,04  | 4,88  | -2,27 | 14,41 |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | -    | -     | 2022                     | -     | -     | -     | 5,67  |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | -    | -     |                          |       |       |       |       |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond  |
|-------------------------|-------|------------------|------|------------------|-------|
| Duration Effettiva      | -     | AAA              | 0,00 | BBB              | 24,43 |
| Maturity effettiva      | 12,92 | AA               | 2,89 | BB               | 39,40 |
| Qualità Credito Media   | BB    | A                | 6,01 | B                | 12,12 |
|                         |       |                  |      | Below B          | 13,71 |
|                         |       |                  |      | Not Rated        | 1,45  |

| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| 2 Year Treasury Note Future...              | —       | 4,19  |
| Ecuador (Republic Of) 6.9%                  | —       | 2,59  |
| Petroleos Mexicanos Sa De CV...             | —       | 1,95  |
| Argentina (Republic Of) 4.125%              | —       | 1,80  |
| Argentina (Republic Of) 3.5%                | —       | 1,63  |
| Morocco (Kingdom of) 4.75%                  | —       | 1,58  |
| Turkey (Republic of) 7.25%                  | —       | 1,53  |
| Colombia (Republic Of) 7.75%                | —       | 1,45  |
| Eagle Funding Luxco S.a.r.l....             | —       | 1,37  |
| Petroleos de Venezuela SA 0%                | —       | 1,30  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 19,38 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 204   |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo | Scadenze % | Fondo |
|----------------------------------|-------|------------|-------|
| Governativo                      | 73,26 | da 1 a 3   | 5,29  |
| Societario                       | 20,95 | da 3 a 5   | 7,17  |
| Cartolarizzazioni                | 0,00  | da 5 a 7   | 10,85 |
| Enti Locali                      | 0,00  | da 7 a 10  | 23,69 |
| Liquidità ed equivalenti         | 8,96  | da 10 a 15 | 19,10 |
| Derivati                         | -3,17 | da 15 a 20 | 6,67  |
|                                  |       | da 20 a 30 | 17,94 |
|                                  |       | oltre 30   | 1,74  |

| Coupon Range %    | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon          | 1,61  |
| Da 0 a 4 cedole   | 9,22  |
| Da 4 a 6 cedole   | 36,30 |
| Da 6 a 8 cedole   | 42,16 |
| Da 8 a 10 cedole  | 9,77  |
| Da 10 a 12 cedole | 0,56  |
| Oltre 12 cedole   | 0,37  |

Anagrafica

|                      |                                       |                         |              |                              |       |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione  | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 2,30 CHF     | Investimento Min. Ingresso   | -     |
| Telefono             | -                                     | (03/02/2026)            |              | Investimento Min. Successivo | -     |
| Web                  | www.bluebayinvest.com                 | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | 0,80% |
| Data di Partenza     | 01/07/2022                            | Valuta del Fondo        | CHF          | Spese correnti               | 0,80% |
| Nome del Gestore     | Jana Velebova                         | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -     |
|                      | Polina Kurdyavko                      | Inc/Acc                 | Acc          |                              |       |
|                      |                                       | ISIN                    | LU1170318882 |                              |       |
| Data Inizio Gestione | 01/12/2017                            |                         |              |                              |       |
| NAV (03/02/2026)     | CHF 127,67                            |                         |              |                              |       |

# BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Bond Fund - Q - CHF accumulating

|                        |            |
|------------------------|------------|
| Patrimonio Netto (Mln) | 983,21 USD |
| (31/12/2025)           |            |