

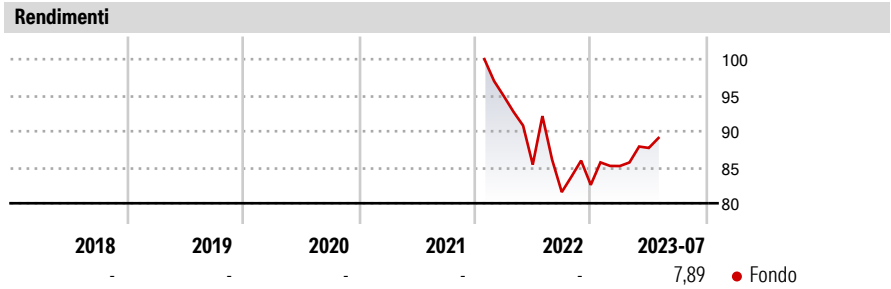
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Bond Fund M - GBP

|                               |                                     |                             |                            |
|-------------------------------|-------------------------------------|-----------------------------|----------------------------|
| <b>Categoria Morningstar™</b> | <b>Benchmark Morningstar</b>        | <b>Benchmark Dichiarato</b> | <b>Morningstar Rating™</b> |
| Obbligazionari Altro          | Not Categorized<br>Usato nel Report | Markit iBoxx EUR Corp TR    | Senza rating               |

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

Conseguire un rendimento totale superiore a quello dell'indice iBoxx Euro Corporates Index, investendo in un portafoglio di titoli a reddito fisso con rating investment grade. Il Comparto investe almeno due terzi del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating investment grade ed emessi da entità domiciliate in paesi europei i cui titoli di stato a lungo termine abbiano un rating investment grade. Il Comparto può investire fino a un terzo del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating investment grade ed emessi da entità domiciliate in paesi non europei i cui titoli di stato a lungo termine abbiano un rating investment grade.

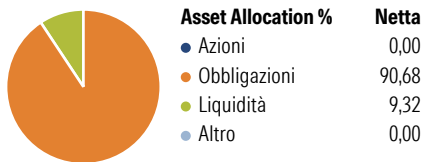
| Misure di Rischio |                   |   |
|-------------------|-------------------|---|
| 3Y Alpha          | - 3Y Sharpe Ratio | - |
| 3Y Beta           | - 3Y Std Dev      | - |
| 3Y R-Squared      | - 3Y Risk         | - |
| 3Y Info Ratio     | - 5Y Risk         | - |
| 3Y Tracking Error | - 10Y Risk        | - |



| Rend. Cumulati % | Fondo | Rendimenti    | Q1   | Q2     | Q3    | Q4   |
|------------------|-------|---------------|------|--------|-------|------|
| 3-Mesi           | 2,76  | Trimestrali % |      |        |       |      |
| 6-Mesi           | 4,65  | 2026          | -    | -      | -     | -    |
| 1-Anno           | 0,46  | 2025          | -    | -      | -     | -    |
| 3-Anni Ann.ti    | -     | 2024          | -    | -      | -     | -    |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | 2023          | 3,17 | 2,95   | -     | -    |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | 2022          | -    | -10,03 | -4,48 | 1,23 |

Rendimenti aggiornati al 29/08/2023

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style    | Fondo |
|-----------------------|-------|
| Box™                  |       |
| Duration Effettiva    | -     |
| Maturità effettiva    | 6,88  |
| Qualità Credito Media | BBB   |

Qualità Credito

Alto Med Basso

Bassa Med Alta

Sensibilità ai Tassi

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|------------------|-------|------------------|-------|
| AAA              | 10,58 | BBB              | 52,89 |
| AA               | 0,74  | BB               | 9,27  |
| A                | 26,50 | B                | 0,00  |
|                  |       | Below B          | 0,00  |
|                  |       | Not Rated        | 0,02  |

| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| Euro Schatz Future Mar 26                   | —       | 17,98 |
| Germany (Federal Republic...                | —       | 4,51  |
| Euro Bobl Future Mar 26                     | —       | 3,90  |
| Germany (Federal Republic...                | —       | 3,10  |
| Germany (Federal Republic...                | —       | 1,18  |
| Germany (Federal Republic...                | —       | 1,16  |
| TotalEnergies Capital...                    | —       | 1,15  |
| HSBC Holdings PLC 3.911%                    | —       | 1,02  |
| UBS Group AG 2.875%                         | —       | 0,99  |
| Morgan Stanley 4.099%                       | —       | 0,97  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 35,96 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 250   |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo  |
|----------------------------------|--------|
| ■ Governativo                    | 16,49  |
| ■ Societario                     | 85,84  |
| ■ Cartolarizzazioni              | 0,00   |
| ■ Enti Locali                    | 0,00   |
| ■ Liquidità ed equivalenti       | 17,95  |
| ■ Derivati                       | -20,27 |
| Coupon Range %                   | Fondo  |
| 0 coupon                         | 3,68   |
| Da 0 a 4 cedole                  | 53,86  |
| Da 4 a 6 cedole                  | 34,55  |
| Da 6 a 8 cedole                  | 5,17   |
| Da 8 a 10 cedole                 | 2,73   |
| Da 10 a 12 cedole                | 0,00   |
| Oltre 12 cedole                  | 0,00   |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 6,03  |
| da 3 a 5   | 11,77 |
| da 5 a 7   | 20,42 |
| da 7 a 10  | 19,63 |
| da 10 a 15 | 12,55 |
| da 15 a 20 | 2,81  |
| da 20 a 30 | 2,02  |
| oltre 30   | 1,67  |

Anagrafica

|                        |                                       |                         |              |                              |            |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione    | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,10 GBP     | Investimento Min. Ingresso   | 10.000 EUR |
| Telefono               | -                                     | (01/12/2014)            | -            | Investimento Min. Successivo | -          |
| Web                    | www.bluebayinvest.com                 | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | T.E.R.                       | -          |
| Data di Partenza       | 31/01/2012                            | Valuta del Fondo        | GBP          | Spese correnti               | 0,61%      |
| Nome del Gestore       | Andrzej Skiba                         | UCITS                   | Si           | Commissione di incentivo     | -          |
|                        | Marc Stacey                           | Inc/Acc                 | Acc          |                              |            |
|                        | Thomas Moulds                         | ISIN                    | LU0720462265 |                              |            |
|                        | Harrison Hill                         |                         |              |                              |            |
| Data Inizio Gestione   | 01/12/2008                            |                         |              |                              |            |
| NAV (29/08/2023)       | GBP 90,64                             |                         |              |                              |            |
| Patrimonio Netto (Mln) | 2.948,03 EUR                          |                         |              |                              |            |
| (31/12/2025)           |                                       |                         |              |                              |            |