

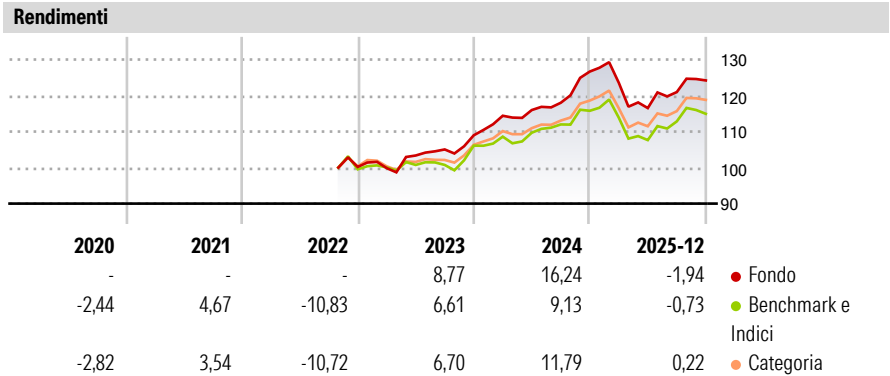
BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund B - USD

| | | | |
|--------------------------------|--|--|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Obbligazionari Paesi Emergenti | Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR USD Usato nel Report | 50% JPM CEMBI Diversified TR USD, 50% JPM EMBI Global Diversified TR USD | ★★★★ |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il fondo si prefigge di conseguire per voi un rendimento combinando la generazione di reddito con la crescita del capitale da voi investito inizialmente e investe prevalentemente in obbligazioni emesse da istituti finanziari che distribuiscono un interesse fisso o variabile. Il fondo mira a conseguire rendimenti migliori di quelli del suo indice di riferimento, che è composto per il 50% da JP Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified e per il restante 50% da JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index (CEMBI) Diversified.

| Misure di Rischio | | | |
|---|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 3,22 | 3Y Sharpe Ratio | 0,65 |
| 3Y Beta | 0,72 | 3Y Std Dev | 6,90 |
| 3Y R-Squared | 88,65 | 3Y Risk | -Med |
| 3Y Info Ratio | 0,95 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 2,74 | 10Y Risk | - |
| Basati su Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR USD (dove applicabile) | | | |



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|------|--------------------------|-------|-------|------|------|
| 3-Mesi | -0,18 | -2,55 | 0,22 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 5,06 | 4,23 | 6,02 | 2025 | -2,46 | -5,68 | 3,82 | 2,67 |
| 1-Anno | -2,03 | -1,94 | 0,58 | 2024 | 4,98 | 1,38 | 1,75 | 7,34 |
| 3-Anni Ann.ti | 6,52 | 3,76 | 5,90 | 2023 | -0,32 | 3,51 | 1,63 | 3,74 |
| 5-Anni Ann.ti | - | 1,16 | 2,63 | 2022 | - | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | 2,78 | 3,55 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 27/01/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | Fondo |
|-------------------------|-------|
| Duration Effettiva | - |
| Maturity effettiva | 9,76 |
| Qualità Credito Media | BB |

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alto

| Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
|------------------|------|------------------|-------|
| AAA | 0,00 | BBB | 22,65 |
| AA | 5,02 | BB | 42,43 |
| A | 3,12 | B | 16,81 |
| | | Below B | 9,94 |
| | | Not Rated | 0,04 |

| Titoli principali | | |
|---|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| 2 Year Treasury Note Future... | — | 10,81 |
| 5 Year Treasury Note Future... | — | 2,81 |
| Samarco Mineracao SA 9.5% | — | 2,50 |
| Banco Mercantil Del Norte SA... | — | 1,36 |
| Ecuador (Republic Of) 6.9% | — | 1,32 |
| Digicel International... | — | 1,29 |
| Argentina (Republic Of) 3.5% | — | 1,22 |
| Ecopetrol S.A. 8.375% | — | 1,15 |
| Grupo Nutresa Sa 9% | — | 1,10 |
| Romania (Republic Of) 5.75% | — | 1,07 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 24,62 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 2 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 254 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|----------------------------------|-------|
| ■ Governativo | 54,72 |
| ■ Societario | 51,02 |
| ■ Cartolarizzazioni | 0,00 |
| ■ Enti Locali | 0,00 |
| ■ Liquidità ed equivalenti | -0,55 |
| ■ Derivati | -5,19 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 1,44 |
| Da 0 a 4 cedole | 9,02 |
| Da 4 a 6 cedole | 26,13 |
| Da 6 a 8 cedole | 41,62 |
| Da 8 a 10 cedole | 20,99 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,33 |
| Oltre 12 cedole | 0,46 |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 5,47 |
| da 3 a 5 | 14,09 |
| da 5 a 7 | 18,30 |
| da 7 a 10 | 16,68 |
| da 10 a 15 | 13,04 |
| da 15 a 20 | 6,21 |
| da 20 a 30 | 9,33 |
| oltre 30 | 1,68 |

Anagrafica

| | | | | | |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,30 USD | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | (27/01/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,90% |
| Data di Partenza | 07/07/2015 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 0,90% |
| Nome del Gestore | Anthony Kettle | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| | Jana Velebova | Inc/Acc | Acc | | |
| | Polina Kurdyavko | ISIN | LU1254391524 | | |
| | Malcolm Kane | | | | |
| Data Inizio Gestione | 06/07/2015 | | | | |
| NAV (27/01/2026) | USD 151,16 | | | | |

BlueBay Emerging Market Aggregate Bond Fund B - USD

| | |
|------------------------|------------|
| Patrimonio Netto (Mln) | 737,61 USD |
| (31/12/2025) | |