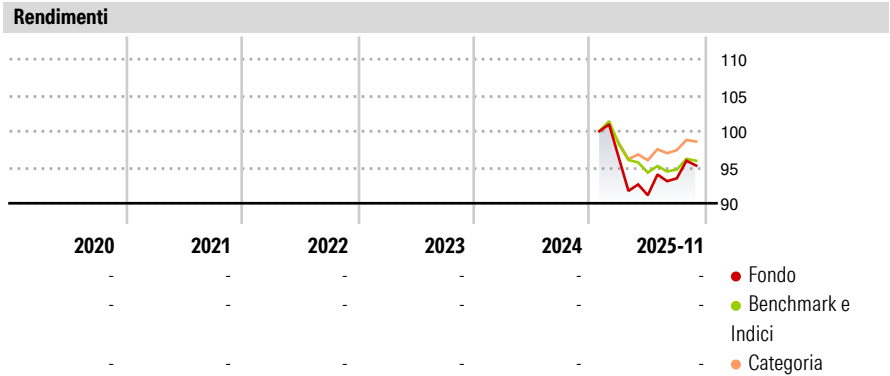


BlueBay Funds - BlueBay Total Return Credit Fund R - USD (MFDiv)

| | | | |
|-----------------------------------|---|-----------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Obbligazionari Flessibili Globali | Morningstar Global Core Bond GR USD Usato nel Report | No benchmark | Senza rating |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il Fondo investe in una vasta gamma di obbligazioni a reddito fisso su scala globale, ivi compresi i mercati emergenti. Si prevede che il Fondo investirà prevalentemente in titoli a reddito fisso che distribuiscono un reddito relativamente elevato e che hanno ottenuto un rating inferiore a quello investment grade da parte di un'agenzia di valutazione (rating) del credito. Il Fondo può inoltre investire in obbligazioni convertibili che distribuiscono un interesse fisso (ma che possono essere scambiate con azioni a un indice concordato qualora ritenuto opportuno). Il Fondo avrà un'esposizione attiva a investimenti sia in USD che in valute diverse dall'USD, ivi comprese le valute dei mercati emergenti.



Misure di Rischio

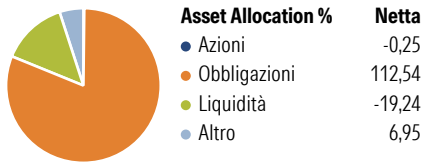
| | | | |
|-------------------|---|-----------------|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | - |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | - |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Basati su Morningstar Global Core Bond GR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|----|-------|------|----|
| 3-Mesi | 1,32 | 0,21 | 0,85 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 3,92 | 0,67 | 2,61 | 2025 | - | -5,41 | 2,57 | - |
| 1-Anno | - | - | - | 2024 | - | - | - | - |
| 3-Anni Ann.ti | - | - | - | 2023 | - | - | - | - |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - | 2022 | - | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 31/12/2025

Portafoglio 30/11/2025



| | | | |
|--------------------------------|--------------|-------------------------|-------------|
| Fixed Income Style Box™ | Fondo | Credit Quality % | Fond |
| Duration Effettiva | - | 0 | 0 |
| Maturity effettiva | 7,47 | | |
| Qualità Credito Media | BB | | |
| | | AAA | 2,12 |
| | | AA | 6,82 |
| | | A | 4,76 |
| | | Below B | 4,90 |
| | | Not Rated | 0,02 |

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

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| 2 Year Treasury Note Future... | — | 20,13 |
| 5 Year Treasury Note Future... | — | 3,88 |
| Intesa Sanpaolo S.p.A. 5.875% | — | 1,59 |
| Credit Agricole S.A. 6.5% | — | 1,26 |
| Barclays PLC 8.875% | — | 0,99 |
| KBC Group NV 6.25% | — | 0,89 |
| BNP Paribas SA 7.75% | — | 0,83 |
| Commerzbank AG 6.5% | — | 0,82 |
| Banco Bilbao Vizcaya... | — | 0,81 |
| Banco Santander, S.A. 9.625% | — | 0,71 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 31,91 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 2 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 429 |

| | | | |
|---|--------------|-------------------|--------------|
| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo | Scadenze % | Fondo |
| Governativo | 48,52 | da 1 a 3 | 11,50 |
| Societario | 60,39 | da 3 a 5 | 18,47 |
| Cartolarizzazioni | 14,61 | da 5 a 7 | 18,12 |
| Enti Locali | 0,00 | da 7 a 10 | 12,74 |
| Liquidità ed equivalenti | -67,89 | da 10 a 15 | 12,44 |
| Derivati | 44,37 | da 15 a 20 | 2,11 |
| | | da 20 a 30 | 2,39 |
| | | oltre 30 | 1,21 |
| Coupon Range % | Fondo | | |
| 0 coupon | 6,27 | | |
| Da 0 a 4 cedole | 8,68 | | |
| Da 4 a 6 cedole | 27,23 | | |
| Da 6 a 8 cedole | 34,91 | | |
| Da 8 a 10 cedole | 18,97 | | |
| Da 10 a 12 cedole | 2,36 | | |
| Oltre 12 cedole | 1,58 | | |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 1,20 USD | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | (31/12/2025) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 1,40% |
| Data di Partenza | 28/01/2025 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 1,40% |
| Nome del Gestore | Not Disclosed | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 01/01/2022 | Inc/Acc | Inc | | |
| NAV (31/12/2025) | USD 101,19 | ISIN | LU2932859007 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 750,15 USD | | | | |

(30/11/2025)