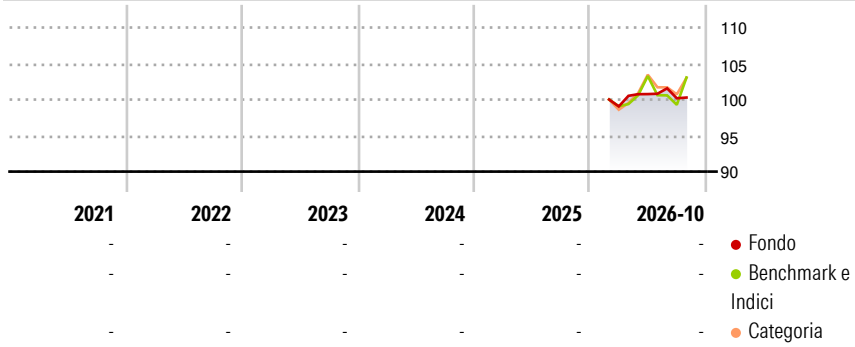
# BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Aggregate Short Duration Bond Fund Q

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| EUR Obbligazionari Paesi Emergenti | Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR USD<br>Usato nel Report | J.P. Morgan JEMB Hard Cur Cr1-3Yr.TR USD | Senza rating |

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the JP Morgan Emerging Market Blend Hard Currency Credit 50-50 1-3 year Index, by investing in a portfolio of short duration fixed income securities issued by entities domiciled in Emerging Market Countries while taking into account ESG considerations. There are no restrictions on the extent to which the Sub-Fund's portfolio and performance may deviate from the ones of the benchmark.

## Rendimenti




## 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 Emerging Markets Sovereign Bond GR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -0,94 | 1,59 | 0,39 |
| 6-Mesi | -0,31 | 3,40 | 3,10 |
| 1-Anno | - | - | - |
| 3-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 04/11/2026

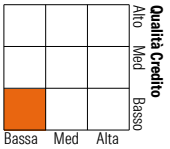
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | - | 1,73 | -0,57 | - |
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | - | - | - | - |
| 2023 | - | - | - | - |
| 2022 | - | - | - | - |

## Portafoglio 30/09/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 84,46 |
| Liquidità | 15,05 |
| Altro | 0,49 |

| Fixed Income Style Box™ | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 1,71 |
| Maturity effettiva | 4,51 |
| Qualità Credito Media | BB |




| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 0,00 | BBB | 21,17 |
| AA | 10,43 | BB | 36,31 |
| A | 3,76 | B | 19,80 |
| | | Below B | 8,53 |
| | | Not Rated | 0,00 |

### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| United States Treasury Notes... | — | 6,70 |
| 2 Year Treasury Note Future... | — | 2,94 |
| Eagle Funding Luxco S.a.r.l.... | — | 1,82 |
| Serbia (Republic Of) 4.25% | — | 1,72 |
| Samarco Mineracao SA 9.5% | — | 1,69 |
| Panama (Republic of) 3.875% | — | 1,66 |
| Greenko Power II Limited 4.3% | — | 1,66 |
| Dominican Republic 5.5% | — | 1,57 |
| Ecuador (Republic Of) 0% | — | 1,45 |
| Romania (Republic Of) 1.375% | — | 1,40 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 22,60 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 163 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 41,31 |
| Societario | 48,78 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 6,83 |
| Derivati | 3,08 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 2,74 |
| Da 0 a 4 cedole | 21,99 |
| Da 4 a 6 cedole | 31,73 |
| Da 6 a 8 cedole | 29,49 |
| Da 8 a 10 cedole | 11,27 |
| Da 10 a 12 cedole | 1,90 |
| Oltre 12 cedole | 0,87 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 50,67 |
| da 3 a 5 | 29,50 |
| da 5 a 7 | 4,87 |
| da 7 a 10 | 0,51 |
| da 10 a 15 | 0,22 |
| da 15 a 20 | 0,00 |
| da 20 a 30 | 0,00 |
| oltre 30 | 0,00 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| Telefono | - |
| Web | www.bluebayinvest.com |
| Data di Partenza | 06/02/2026 |
| Nome del Gestore | Anthony Kettle<br>Jana Velebova<br>Polina Kurdyavko |
| Data Inizio Gestione | 11/07/2019 |
| NAV (04/11/2026) | EUR 100,60 |
| Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2026) | 513,21 USD |
| Patrimonio Classe (Mln) (04/11/2026) | 34,91 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU3114030284 |
| Investimento Min. Ingresso | - |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,70% |
| Spese correnti | 0,70% |
| Commissione di incentivo | - |

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR