

## Documento contenente le informazioni chiave

### Scopo

Il presente documento fornisce le informazioni chiave relative a questo prodotto di investimento. Non si tratta di un documento promozionale. Le informazioni, prescritte per legge, hanno lo scopo di aiutarvi a capire le caratteristiche, i rischi, i costi e i guadagni e le perdite potenziali di questo prodotto e di aiutarvi a fare un raffronto con altri prodotti d'investimento.

### Prodotto

|   |   |
|---|---|
| <b>Nome del prodotto:</b>   | BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund - R - USD |
| <b>Nome dell'ideatore del PRIIP:</b>  | BlueBay Funds Management Company S.A.                                 |
| <b>ISIN:</b>  | LU0356217504  |
| <b>Sito Web:</b>  | <a href="http://www.rbcbluebay.com">www.rbcbluebay.com</a>            |
| <b>Numero di telefono:</b>  | +352 274 7571   |
| <b>Nome dell'Autorità competente:</b>   | Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF)                |
| <b>Il PRIIP è autorizzato in:</b>   | Lussemburgo   |
| <b>Data di realizzazione del documento contenente le informazioni chiave:</b> | 25/11/2025  |

### Cos'è questo prodotto?

#### Tipo

Il fondo si qualifica come OICVM di diritto lussemburghese.

#### Termine

Questo prodotto non prevede un periodo di investimento minimo, ma è concepito per investimenti a medio-lungo termine e il periodo di investimento minimo consigliato è di 5 anni. Il periodo d'investimento minimo consigliato si basa sul profilo di rischio/rendimento del fondo. L'eventuale cessione del fondo prima del periodo d'investimento minimo consigliato comporta un rischio maggiore di oscillazione del valore del fondo stesso.

#### Obiettivi

Il fondo mira a generare un rendimento per gli investitori combinando la generazione di reddito con la crescita del capitale iniziale. Investe principalmente in obbligazioni che pagano un interesse fisso.

Il fondo è gestito attivamente e mira a conseguire rendimenti migliori di quelli del proprio parametro di riferimento, ossia JP Morgan Corporate Emerging Market Bond Index (CEMBI) Diversified, tenendo conto delle considerazioni relative ai fattori ambientali, sociali e di governance ("ESG"). Non vi sono limiti alla misura in cui il portafoglio e la performance del fondo possano discostarsi da quelli del parametro di riferimento. Nell'ambito del processo d'investimento, il Gestore degli investimenti ha piena discrezionalità sulla composizione del portafoglio del fondo e può esporsi a società, paesi o settori non inclusi nel parametro di riferimento. Almeno due terzi degli investimenti del fondo saranno effettuati in obbligazioni a reddito fisso, dotate di qualsiasi rating o prive di rating, emesse da società aventi sede in paesi dei mercati

emergenti (che possono comprendere titoli di emittenti in difficoltà finanziaria) denominate in qualunque valuta.

In conformità all'Articolo 8 del SFDR, il fondo promuove caratteristiche ambientali e sociali e investimenti che si attengano a prassi di buona governance. Le caratteristiche ambientali e sociali promosse dal fondo consistono nel favorire gli investimenti in emittenti che, con la propria attività e/o condotta aziendale, adottano un approccio appropriato e responsabile rispetto alle tematiche ESG. Ulteriori informazioni sulle caratteristiche ambientali e sociali promosse dal fondo sono disponibili nell'Appendice 2 del prospetto.

Il fondo può utilizzare derivati (come futures, opzioni e swap, che sono legati ai movimenti al rialzo e al ribasso di altre attività) per acquisire, aumentare o ridurre l'esposizione alle relative attività sottostanti, dando così origine a un effetto leva (gearing) che può tradursi in maggiori oscillazioni del valore del fondo. Il gestore del fondo farà in modo che l'uso dei derivati non modifichi in modo significativo il profilo di rischio complessivo del fondo stesso.

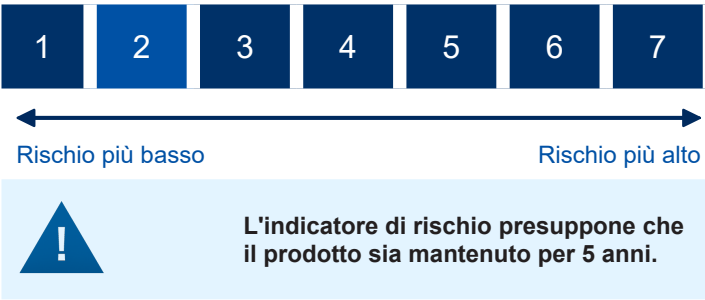
Per informazioni dettagliate sull'obiettivo e sulla politica d'investimento del fondo, consultare il prospetto. È possibile acquistare e vendere azioni ogni giorno lavorativo a Londra e in Lussemburgo, conformemente ai termini esposti nella sezione Informazioni generali del prospetto.

#### Investitori al dettaglio cui si intende commercializzare il prodotto

Questo prodotto è destinato a tutti gli investitori al dettaglio con un orizzonte d'investimento a medio-lungo termine (da 3 a 5 anni).

Quali sono i rischi e qual è il potenziale rendimento?

Indicatore di rischio



L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esso esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a

causa di movimenti sul mercato o a causa della nostra incapacità di pagarvi quanto dovuto.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 2 su 7, che corrisponde alla classe di rischio bassa. Ciò significa che le potenziali perdite derivanti da performance future sono basse e che è molto improbabile che condizioni di mercato sfavorevoli abbiano un impatto sulla nostra capacità di pagarvi quanto dovuto.

Per effetto di condizioni di mercato insolite, potrebbero verificarsi altri rischi, tra cui: rischio di controparte e rischio di liquidità. Per maggiori dettagli si rimanda al prospetto.

Questo prodotto non prevede alcuna protezione dall'andamento futuro del mercato, pertanto l'investitore potrebbe perdere tutto o parte del suo investimento.

Performance Scenari

Il possibile rimborso dipenderà dall'andamento futuro dei mercati, che è incerto e non può essere previsto con esattezza. Lo scenario sfavorevole, lo scenario moderato e lo scenario favorevole riportati sono illustrazioni basate sulla performance peggiore, sulla performance media e sulla performance migliore del prodotto/di un parametro di riferimento idoneo conseguita negli ultimi 10 anni. Nel futuro i mercati potrebbero avere un andamento molto diverso.

| Periodo di detenzione raccomandato:5 anni |  |                               |                               |
|---|--|-------------------------------|-------------------------------|
| Esempio di investimento:10,000 \$         |  |                               |                               |
| Scenari                                   |  | In caso di uscita dopo 1 anno | In caso di uscita dopo 5 anni |
| Minimo                                    | Non esiste un rendimento minimo garantito in caso di uscita prima di 5 anni. Potreste perdere il vostro intero investimento o parte di esso. |                               |                               |
| Stress                                    | Possibile rimborso al netto dei costi  | 7,840 \$                      | 7,800 \$                      |
|   | Rendimento medio per ciascun anno  | -21.58%                       | -4.84%                        |
| Sfavorevole                               | Possibile rimborso al netto dei costi  | 7,840 \$                      | 8,720 \$                      |
|   | Rendimento medio per ciascun anno  | -21.58%                       | -2.71%                        |
| Moderato                                  | Possibile rimborso al netto dei costi  | 10,620 \$                     | 10,550 \$                     |
|   | Rendimento medio per ciascun anno  | 6.17%                         | 1.08%                         |
| Favorevole                                | Possibile rimborso al netto dei costi  | 12,440 \$                     | 13,550 \$                     |
|   | Rendimento medio per ciascun anno  | 24.36%                        | 6.27%                         |

Lo scenario di stress indica quale potrebbe essere l'importo rimborsato in circostanze di mercato estreme.

Le cifre riportate comprendono tutti i costi del prodotto in quanto tale, ma possono non comprendere tutti i costi da voi pagati al consulente o al distributore. Le cifre non tengono conto della vostra situazione fiscale personale, che può incidere anch'essa sull'importo del rimborso.

Lo scenario sfavorevole si è verificato nel periodo 10 2017 - 10 2022.

Lo scenario moderato si è verificato nel periodo 02 2020 - 02 2025.

Lo scenario favorevole si è verificato nel periodo 01 2016 - 01 2021.

Cosa accade se BlueBay Funds Management Company S.A. non è in grado di corrispondere quanto dovuto?

L'investitore potrebbe non subire una perdita finanziaria dovuta all'insolvenza di BlueBay Funds Management Company S.A.

Le attività del fondo sono detenute in custodia dal suo depositario, Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (il "Depositario"). In caso di insolvenza di BlueBay Funds Management Company S.A., le attività del fondo custodite dal Depositario non saranno interessate. Tuttavia, in caso di insolvenza del Depositario o di un soggetto che agisce per suo conto, il fondo potrebbe subire una perdita finanziaria. Ad ogni modo, tale rischio è in parte attenuato dal fatto che il Depositario è tenuto, ai sensi delle leggi e dei regolamenti vigenti, a separare le proprie attività da quelle del fondo. Il Depositario sarà altresì responsabile nei confronti del fondo di eventuali perdite derivanti, tra l'altro, da negligenza, frode o mancato o inesatto adempimento intenzionale dei propri obblighi (fatte salve alcune limitazioni previste dal contratto con il Depositario). Gli investitori del fondo non sono coperti da alcun regime di compensazione e, nel peggiore dei casi, potrebbero perdere l'intero investimento.

Quali sono i costi?

La persona che fornisce consulenza sul PRIIP o che lo vende potrebbe addebitare altri costi, nel qual caso fornirà informazioni su tali costi, illustrandone l'impatto sull'investimento.

## Andamento dei costi nel tempo

Le tabelle mostrano gli importi prelevati dall'investimento per coprire diversi tipi di costi. Tali importi dipendono dall'entità dell'investimento, dalla durata della detenzione del prodotto. Gli importi sono qui riportati a fini illustrativi e si basano su un importo esemplificativo dell'investimento e su diversi possibili periodi di investimento.

Si è ipotizzato quanto segue:

- Nel primo anno recupero dell'importo investito (rendimento annuo dello 0%). Per gli altri periodi di detenzione si è ipotizzato che il prodotto abbia la performance indicata nello scenario moderato.
- 10,000 USD di investimento

|  | In caso di uscita dopo 1 anno | In caso di uscita dopo 5 anni |
|--|-------------------------------|-------------------------------|
| <b>Costi totali</b>                    | 221 \$                        | 1,138 \$                      |
| <b>Incidenza annuale dei costi (*)</b> | 2.2%                          | 2.2% ogni anno                |

(\*) Dimostra come i costi riducano ogni anno il rendimento nel corso del periodo di detenzione. Ad esempio, se l'uscita avviene nel periodo di detenzione raccomandato, si prevede che il rendimento medio annuo sarà pari al(lo) 3.2% prima dei costi e al(lo) 1.1% al netto dei costi.

## Composizione dei costi

| Costi una tantum di ingresso o di uscita                                   |  | In caso di uscita dopo 1 anno |
|--|--|-------------------------------|
| <b>Costi di ingresso</b>   | Non addebitiamo alcuna commissione di ingresso per questo prodotto.  | 0 USD                         |
| <b>Costi di Uscita</b>   | Non addebitiamo una commissione di uscita per questo prodotto ma la persona che vende il prodotto può farlo.   | 0 USD                         |
| Costi correnti registrati ogni anno  |  |                               |
| <b>Commissioni di gestione e altri costi amministrativi o di esercizio</b> | 1.70% del valore dell'investimento all'anno. Si tratta di una stima basata sui costi effettivi dell'ultimo anno.   | 174 USD                       |
| <b>Costi di transazione</b>  | 0.46% del valore dell'investimento all'anno. Si tratta di una stima dei costi sostenuti per l'acquisto e la vendita degli investimenti sottostanti per il prodotto. L'importo effettivo varierà a seconda dell'importo che viene acquistato e venduto. | 47 USD                        |
| Oneri accessori sostenuti in determinate condizioni                        |  |                               |
| <b>Commissioni di performance</b>  | Non è prevista alcuna commissione di performance per questo prodotto.  |                               |

## Per quanto tempo devo detenerlo? Posso ritirare il capitale prematuramente?

### Periodo di detenzione raccomandato: 5 anni

Questo fondo non prevede un periodo di investimento minimo, ma è concepito per investimenti a medio-lungo termine e il periodo di investimento minimo consigliato è di 5 anni.

Il periodo d'investimento minimo consigliato si basa sul profilo di rischio/rendimento del fondo. È possibile vendere le azioni del fondo in qualsiasi giorno lavorativo a Londra e a Lussemburgo senza che vengano addebitati oneri di uscita. Tuttavia, l'eventuale cessione prima del periodo d'investimento minimo consigliato comporta un rischio maggiore di oscillazione del valore del fondo stesso.

## Come presentare reclami?

I reclami possono essere presentati per iscritto, tramite e-mail o posta all'attenzione del Complaints Handling Officer, ai seguenti indirizzi: [BFMC\\_Complaints@bluebay.com](mailto:BFMC_Complaints@bluebay.com) o BlueBay Funds Management Company S.A. 4, Boulevard Royal L-2449 Lussemburgo. I reclami possono essere inoltrati direttamente o tramite l'intermediario finanziario dell'Investitore.

## Altre informazioni pertinenti

Copie del prospetto e dell'ultima relazione annuale e semestrale di BlueBay Funds in inglese, tedesco, francese, italiano, spagnolo e norvegese, nonché altre informazioni pratiche quali l'ultimo prezzo delle azioni, sono disponibili gratuitamente presso la Sede legale di BlueBay Funds, 80, Route d'Esch, L-1470 Lussemburgo e sul nostro sito Web, [www.rbcbluebay.com](http://www.rbcbluebay.com)

Le informazioni relative alle performance passate degli ultimi 10 anni del prodotto sono disponibili all'indirizzo: [https://docs.publifund.com/pastperf/LU0356217504/it\\_IT](https://docs.publifund.com/pastperf/LU0356217504/it_IT)

I calcoli dello scenario di performance precedente sono disponibili all'indirizzo: [https://docs.publifund.com/monthlyperf/LU0356217504/it\\_IT](https://docs.publifund.com/monthlyperf/LU0356217504/it_IT)