

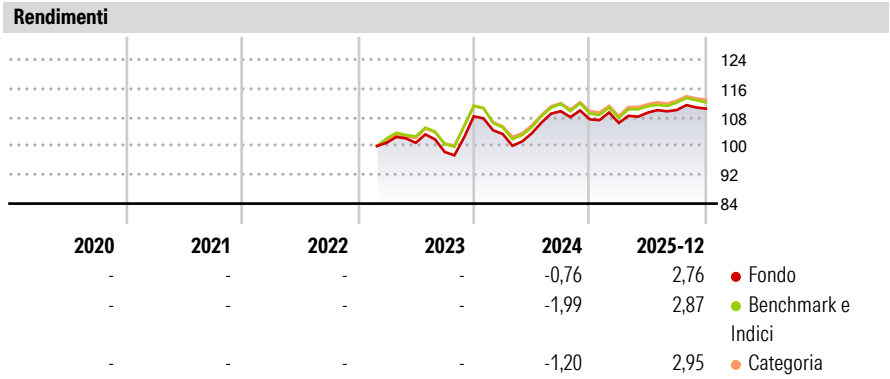
BlueBay Funds - BlueBay Impact-Aligned Bond Fund - R - CHF accumulating

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Global Corporate Bond - CHF Hedged	Morningstar Global Corporate Bond GR Hedged CHF Usato nel Report	No benchmark	Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund is actively managed, does not reference any benchmark and aims to achieve a total return from a portfolio of investment grade-rated fixed income securities selected on the basis that securities qualify as Sustainable Investments. The Sub-Fund invests at least two-thirds13 of its net assets in fixed and floating rate fixed income securities rated investment grade. The Sub-Fund invests at least 50% of its net assets in corporate issuers globally (including Emerging Market Issuers). The Sub-Fund may invest up to one-third of its net assets in fixed income securities rated below investment grade provided that such securities are not rated below B-/B3.

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 Corporate Bond GR Hedged CHF (dove applicabile)		



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,77	0,68	0,79	2026	-	-	-	-
6-Mesi	2,15	2,39	2,56	2025	-0,94	2,69	0,67	0,34
1-Anno	5,05	5,06	5,44	2024	-4,54	0,18	5,95	-2,05
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-	-0,02	-2,51	10,06
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	7,00
Qualità Credito Media	BB
Qualità Credito: Alto, Med, Basso	
Sensibilità ai Tassi: Basso, Med, Alto	

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	0,42	BBB	52,90
AA	5,53	BB	17,75
A	17,63	B	5,68
		Below B	0,08
		Not Rated	0,00

Titoli principali		
Nome	Settore	%
5 Year Treasury Note Future...	—	13,19
2 Year Treasury Note Future...	—	9,59
Ultra US Treasury Bond...	—	5,66
10 Year Treasury Note Future...	—	5,34
US Treasury Bond Future Mar 26	—	5,09
Carrier Global Corporation...	—	2,67
UCB SA 4.25%	—	2,15
Severn Trent Utilities...	—	2,14
Ipsen SA 3.875%	—	2,04
Transport For London 5.75%	—	1,93
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		49,80
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		128

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	20,81
Societario	82,36
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-69,06
Derivati	65,89
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	1,17
Da 0 a 4 cedole	54,22
Da 4 a 6 cedole	29,95
Da 6 a 8 cedole	11,82
Da 8 a 10 cedole	2,33
Da 10 a 12 cedole	0,52
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	7,13
da 3 a 5	11,66
da 5 a 7	19,01
da 7 a 10	14,56
da 10 a 15	8,28
da 15 a 20	1,50
da 20 a 30	2,24
oltre 30	0,93

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	0,02 USD (29/01/2026)	Investimento Min. Ingresso	1.000.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	CHF	T.E.R.	0,89%
Data di Partenza	27/02/2023	UCITS	Si	Spese correnti	0,89%
Nome del Gestore	Harrison Hill Robert Lambert Thomas Moulds	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
ISIN	LU2566049065				
Data Inizio Gestione	04/05/2021				
NAV (29/01/2026)	CHF 103,51				

BlueBay Funds - BlueBay Impact-Aligned Bond Fund - R - CHF accumulating

Patrimonio Netto (Mln)	214,84 USD
(31/12/2025)	