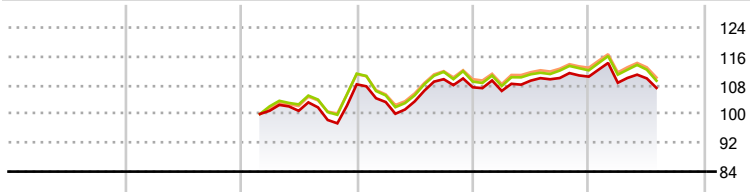
# BlueBay Funds - BlueBay Impact-Aligned Bond Fund - R - CHF accumulating

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Global Corporate Bond - CHF Hedged | Morningstar Global Corporate Bond GR Hedged CHF<br>Usato nel Report | Not Benchmarked | 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 80% of its net assets in fixed and floating rate fixed income securities. 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. The Sub-Fund may invest in USD and non-USD denominated securities, except securities denominated in the Local...

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-07 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | - | - | - | -0,76 | 2,76 | -2,84 |
| Benchmark e Indici | - | - | - | -1,99 | 2,87 | - |
| Categoria | - | - | - | -1,20 | 2,95 | - |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -0,03 | 3Y Sharpe Ratio | -0,16 |
| 3Y Beta | 0,95 | 3Y Std Dev | 7,86 |
| 3Y R-Squared | 96,33 | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | -0,02 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 0,98 | 10Y Risk | - |

Basati su Morningstar Global Corporate Bond GR Hedged CHF (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -3,53 | -1,21 | -0,81 |
| 6-Mesi | -6,60 | -4,06 | -3,69 |
| 1-Anno | -2,79 | -4,89 | -4,70 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,73 | 2,10 | 2,59 |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 28/08/2026

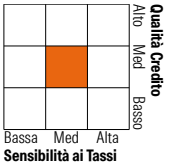
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -1,54 | 1,12 | - | - |
| 2025 | -0,94 | 2,69 | 0,67 | 0,34 |
| 2024 | -4,54 | 0,18 | 5,95 | -2,05 |
| 2023 | - | -0,02 | -2,51 | 10,06 |
| 2022 | - | - | - | - |

## Portafoglio 30/09/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 88,64 |
| Liquidità | 10,57 |
| Altro | 0,79 |

**Fixed Income Style Box™**




| | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 5,94 |
| Maturity effettiva | 7,26 |
| Qualità Credito Media | BBB |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 1,30 | BBB | 58,32 |
| AA | 5,60 | BB | 18,89 |
| A | 13,93 | B | 1,81 |
| | | Below B | 0,15 |
| | | Not Rated | 0,00 |

## Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| Elia Group SA/NV 4.625% | — | 2,33 |
| Veralto Corp. 4.85% | — | 2,17 |
| ADSK 5.65 09/15/33 | — | 2,14 |
| Pearson Funding plc 6.375% | — | 2,06 |
| African Development Bank... | — | 1,98 |
| Lansforsakringar Bank AB... | — | 1,95 |
| UCB SA 4.25% | — | 1,88 |
| Severn Trent Utilities... | — | 1,82 |
| Ipsen SA 3.875% | — | 1,76 |
| SPIEFP 4 7/8 03/32 REGS | — | 1,69 |

| | |
|---|---|
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | 19,77 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | 132 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 3,62 |
| Societario | 86,07 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 10,01 |
| Derivati | 0,29 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 1,07 |
| Da 0 a 4 cedole | 35,46 |
| Da 4 a 6 cedole | 46,38 |
| Da 6 a 8 cedole | 16,70 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,23 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,15 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

| Scadenze % | Fondo |
|---|---|
| da 1 a 3 | 6,92 |
| da 3 a 5 | 21,19 |
| da 5 a 7 | 26,62 |
| da 7 a 10 | 27,25 |
| da 10 a 15 | 4,92 |
| da 15 a 20 | 1,79 |
| da 20 a 30 | 5,81 |
| oltre 30 | 4,37 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| Telefono | - |
| Web | www.bluebayinvest.com |
| Data di Partenza | 27/02/2023 |
| Nome del Gestore | Harrison Hill<br>Robert Lambert<br>Thomas Moulds |
| Data Inizio Gestione | 04/05/2021 |
| NAV (28/08/2026) | CHF 100,59 |
| Patrimonio Classe (Mln) (28/08/2026) | 0,01 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | CHF |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU2566049065 |
| Investimento Min. Ingresso | 1.000.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,89% |
| Spese correnti | 0,89% |
| 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

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

| | |
|---|---|
| Patrimonio Netto (MIn) | 228,39 USD |
| (30/09/2026) | |

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.