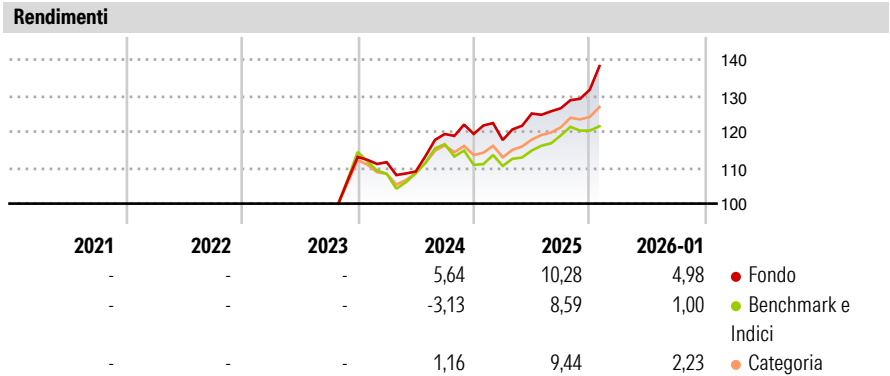


BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Unconstrained Bond Fund R - CHF

| | | | |
|-------------------------------|---|-----------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Category_EUCA001034 | Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged CHF Usato nel Report | No benchmark | Senza rating |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Conseguire un rendimento assoluto facendo ricorso a una strategia basata su una combinazione di posizioni long e short (tramite l'utilizzo di strumenti finanziari derivati) in un portafoglio di titoli a reddito fisso prevalentemente di Emittenti dei paesi emergenti distribuiti e denominati in qualsiasi valuta, oltre che in titoli legati, direttamente o indirettamente, a valute e/o tassi d'interesse di Paesi 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 Emerging Markets Sovereign Bond GR Hedged CHF (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|------|------|
| 3-Mesi | 7,97 | 1,56 | 3,30 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 12,15 | 6,06 | 7,84 | 2025 | -1,41 | 6,26 | 1,16 | 4,06 |
| 1-Anno | 14,36 | 10,23 | 11,74 | 2024 | -1,30 | -2,33 | 9,57 | 0,02 |
| 3-Anni Ann.ti | - | - | - | 2023 | - | - | - | - |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - | 2022 | - | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 30/11/2025

| | | | | | | | | |
|----------------|---------------------------|--------------|---------------------------|-----------------------|-------------------------|-------------|-------------------------|-------------|
| | Asset Allocation % | Netta | Fixed Income Style | Fondo | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % | Fond |
| ● Azioni | 0,00 | 0,00 | Box™ | Duration Effettiva | - | 0 | | 0 |
| ● Obbligazioni | 111,87 | 111,87 | | Maturità effettiva | - | | | |
| ● Liquidità | -13,80 | -13,80 | | Qualità Credito Media | | | | |
| ● Altro | 1,93 | 1,93 | | | | | | |

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

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Colombia (Republic Of) 7.75% | — | 3,99 |
| Colombia (Republic Of) 13.25% | — | 3,97 |
| Buenos Aires (Province Of)... | — | 3,97 |
| Ecuador (Republic Of) 6.9% | — | 3,41 |
| Bogota, Distrito Capital... | — | 3,07 |
| Turkey (Republic of) 6.8% | — | 3,01 |
| Argentina (Republic Of) 4.125% | — | 3,01 |
| Indonesia (Republic of) 7.125% | — | 2,62 |
| Zambia (Republic Of) 5.75% | — | 2,43 |
| Central Bank Of Tunisie SA... | — | 2,28 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 31,77 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 126 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|----------------------------------|--------------|
| ■ Governativo | 114,17 |
| ■ Societario | 16,51 |
| ■ Cartolarizzazioni | 0,00 |
| ■ Enti Locali | 0,00 |
| ■ Liquidità ed equivalenti | -37,90 |
| ■ Derivati | 7,21 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 7,33 |
| Da 0 a 4 cedole | 1,28 |
| Da 4 a 6 cedole | 8,89 |
| Da 6 a 8 cedole | 39,70 |
| Da 8 a 10 cedole | 22,60 |
| Da 10 a 12 cedole | 7,41 |
| Oltre 12 cedole | 12,79 |

| Scadenze % | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 14,18 |
| da 3 a 5 | 23,96 |
| da 5 a 7 | 6,79 |
| da 7 a 10 | 20,25 |
| da 10 a 15 | 16,85 |
| da 15 a 20 | 1,28 |
| da 20 a 30 | 7,14 |
| oltre 30 | 1,07 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 1,98 CHF | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | (11/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 1,70% |
| Data di Partenza | 05/10/2023 | Valuta del Fondo | CHF | Spese correnti | 1,70% |
| Nome del Gestore | Polina Kurdyavko | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| | Anthony Kettle | Inc/Acc | Acc | | |
| | Brent David | ISIN | LU2672462541 | | |
| Data Inizio Gestione | 01/06/2016 | | | | |
| NAV (11/02/2026) | CHF 135,28 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 870,73 USD | | | | |

(30/11/2025)