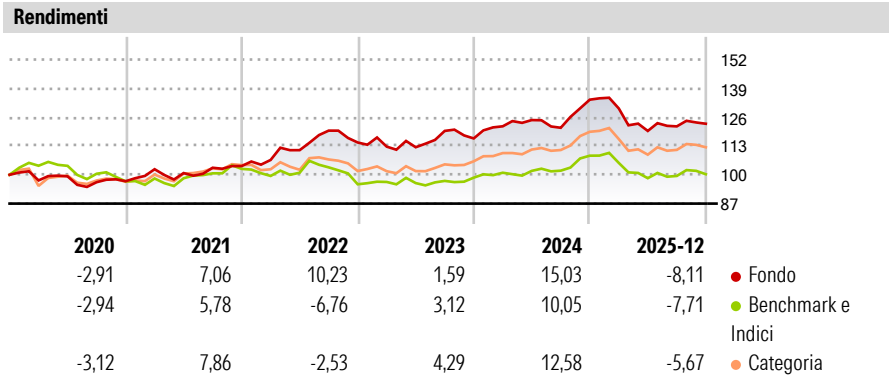


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund B - USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Global Flexible Bond - USD Hedged	Morningstar Global Core Bond GR Hedged USD Usato nel Report	ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR LOC	★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Conseguire un rendimento totale superiore a quello dell'indice Merrill Lynch Euro Currency Libor 3-Month Constant Maturity Index, investendo in un portafoglio di titoli a reddito fisso con rating investment grade. Il Comparto investe almeno il 50% del patrimonio netto in titoli a reddito fisso con rating investment grade.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	0,72	3Y Sharpe Ratio	-0,03
3Y Beta	-0,14	3Y Std Dev	8,04
3Y R-Squared	6,64	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,16	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	5,38	10Y Risk	-Med

Basati su Morningstar Global Core Bond GR Hedged USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,14	-1,30	-0,35	2026	-	-	-	-
6-Mesi	2,64	2,16	3,25	2025	-2,94	-7,82	1,73	0,97
1-Anno	-7,66	-7,10	-5,08	2024	4,71	2,31	-2,79	10,45
3-Anni Ann.ti	2,98	1,41	3,25	2023	-1,63	-0,25	6,56	-2,84
5-Anni Ann.ti	4,73	0,69	2,82	2022	2,66	4,13	7,93	-4,46
10-Anni Ann.ti	3,04	1,24	2,75					

Rendimenti aggiornati al 22/01/2026

Portafoglio 31/12/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	113,45
Liquidità	-13,81
Altro	0,35

Fixed Income Style Box™

Duration Effettiva: -
Maturità effettiva: 10,65
Qualità Credito Media: BBB

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

Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
AAA	20,81	BBB	41,63
AA	0,84	BB	13,70
A	22,99	B	0,00
		Below B	0,00
		Not Rated	0,03

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Germany (Federal Republic...	—	9,63
Colombia (Republic Of) 13.25%	—	2,32
Mexico (United Mexican...	—	2,30
Japan (Government Of) 2.2%	—	2,15
Ministerio de Hacienda y...	—	2,03
Romania (Republic Of) 6.125%	—	1,83
Mexico (United Mexican...	—	1,43
Germany (Federal Republic...	—	1,31
South Africa (Republic of)...	—	1,27
Germany (Federal Republic...	—	1,26
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		25,54
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		235

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	96,16
Societario	50,05
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	11,11
Derivati	-57,32
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
Da 4 a 6 cedole	0,00
Da 6 a 8 cedole	0,00
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	59,80
da 3 a 5	4,89
da 5 a 7	7,75
da 7 a 10	10,68
da 10 a 15	6,08
da 15 a 20	1,37
da 20 a 30	5,70
oltre 30	2,32

Anagrafica			
Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	3,20 USD
Telefono	-	(22/01/2026)	
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO
Data di Partenza	17/05/2012	Valuta del Fondo	USD
Nome del Gestore	-	UCITS	Si
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Acc
NAV (22/01/2026)	USD 160,94	ISIN	LU0627762262
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
(31/12/2025)		Investimento Min. Successivo	-
		T.E.R.	1,20%
		Spese correnti	1,20%
		Commissione di incentivo	-