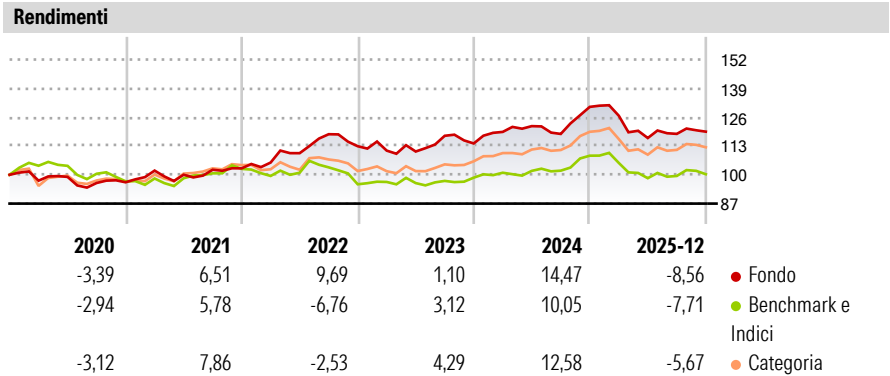


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund R - USD

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	0,23	3Y Sharpe Ratio	-0,10
3Y Beta	-0,13	3Y Std Dev	8,03
3Y R-Squared	6,63	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,07	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	0,01	-1,30	-0,35	2026	-	-	-	-
6-Mesi	2,39	2,16	3,25	2025	-3,06	-7,95	1,61	0,84
1-Anno	-8,11	-7,10	-5,08	2024	4,58	2,19	-2,89	10,31
3-Anni Ann.ti	2,47	1,41	3,25	2023	-1,75	-0,37	6,42	-2,95
5-Anni Ann.ti	4,22	0,69	2,82	2022	2,54	4,00	7,79	-4,57
10-Anni Ann.ti	2,53	1,24	2,75					

Rendimenti aggiornati al 22/01/2026

Portafoglio 31/12/2025				Fixed Income Style				Credit Quality %			
	Asset Allocation %	Netta		Box™	Duration Effettiva	Fondo		Fond	Credit Quality %	Fond	
	● Azioni	0,00			Maturità effettiva	-		0		0	
	● Obbligazioni	113,45			Qualità Credito Media	10,65					
	● Liquidità	-13,81									
	● Altro	0,35									

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)	1,60 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	(22/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,70%
Data di Partenza	05/07/2012	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,70%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Acc		
NAV (22/01/2026)	USD 148,05	ISIN	LU0627762429		
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR				
(31/12/2025)					