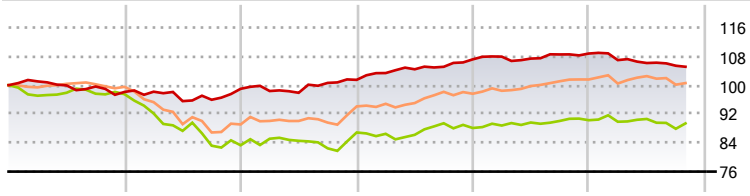
# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund R - EUR (AIDiv)

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari Flessibili Globali - EUR Hedged | Morningstar Global Core Bond GR Hedged EUR<br>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.

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | -1,88 | 0,88 | 2,52 | 5,60 | 1,51 | -3,38 |
| Benchmark e Indici | -2,52 | -14,54 | 4,26 | 1,43 | 2,45 | -0,98 |
| Categoria | -0,50 | -10,42 | 5,73 | 3,74 | 4,24 | -0,93 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -1,27 | 3Y Sharpe Ratio | -0,63 |
| 3Y Beta | 0,00 | 3Y Std Dev | 2,11 |
| 3Y R-Squared | 0,00 | 3Y Risk | Basso |
| 3Y Info Ratio | -0,35 | 5Y Risk | Basso |
| 3Y Tracking Error | 4,53 | 10Y Risk | -Med |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -1,25 | -0,03 | -1,33 |
| 6-Mesi | -1,83 | -0,39 | -0,92 |
| 1-Anno | -3,34 | -0,81 | -0,42 |
| 3-Anni Ann.ti | 1,22 | 2,80 | 3,97 |
| 5-Anni Ann.ti | 1,22 | -1,76 | 0,03 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,11 | -0,34 | 0,75 |

Rendimenti aggiornati al 06/11/2026

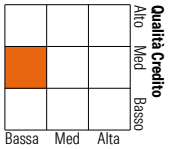
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -1,68 | -0,75 | -0,72 | - |
| 2025 | 0,71 | -0,50 | 1,07 | 0,23 |
| 2024 | 1,86 | 1,01 | 0,66 | 1,96 |
| 2023 | -0,62 | -0,49 | 2,80 | 0,85 |
| 2022 | 0,06 | -2,67 | 0,40 | 3,16 |

## Portafoglio 30/09/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | 156,83 |
| Liquidità | -56,82 |
| Altro | -0,01 |

**Fixed Income Style Box™**




| Fixed Income Style Box™ | Fondo |
|---|---|
| Duration Effettiva | 2,66 |
| Maturity effettiva | 8,62 |
| Qualità Credito Media | BBB |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|
| AAA | 25,33 | BBB | 42,38 |
| AA | 0,31 | BB | 12,35 |
| A | 19,22 | B | 0,27 |
| | | Below B | 0,00 |
| | | Not Rated | 0,14 |

## Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| 5 Year Treasury Note Future... | — | 25,28 |
| Germany (Federal Republic... | — | 20,42 |
| 10 Year Treasury Note Future... | — | 7,52 |
| Colombia (Republic Of) 13.25% | — | 3,09 |
| Mexico (United Mexican... | — | 2,51 |
| Japan (Government Of) 2.2% | — | 2,37 |
| Iceland (Republic Of) 6.5% | — | 1,74 |
| Mexico (United Mexican... | — | 1,41 |
| Mexico (United Mexican... | — | 1,39 |
| Deutsche Bank AG 8.125% | — | 1,24 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 66,97 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 224 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 135,09 |
| Societario | 51,65 |
| Cartolarizzazioni | 0,00 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | -1.047,49 |
| Derivati | 960,75 |

| 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 | 52,63 |
| da 3 a 5 | 6,20 |
| da 5 a 7 | 5,79 |
| da 7 a 10 | 5,82 |
| da 10 a 15 | 3,93 |
| da 15 a 20 | 0,57 |
| da 20 a 30 | 2,58 |
| oltre 30 | 1,65 |

## Anagrafica

| | |
|---|---|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| Telefono | - |
| Web | www.bluebayinvest.com |
| Data di Partenza | 08/08/2013 |
| Nome del Gestore | Mark Dowding<br>Marc Stacey<br>Thomas Moulds<br>Russel Matthews<br>Russell Vincent |
| Data Inizio Gestione | 01/04/2025 |
| NAV (06/11/2026) | EUR 81,35 |
| Patrimonio Classe (Mln) (06/11/2026) | 0,32 EUR |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | EUR |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Inc |
| ISIN | LU0627762007 |
| Investimento Min. Ingresso | - |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 1,70% |
| Spese correnti | 1,70% |
| 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 Investment Grade Absolute Return Bond Fund R - EUR (AIDiv)

| | |
|---|---|
| Patrimonio Netto (MIn) | 857,43 EUR |
| (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.