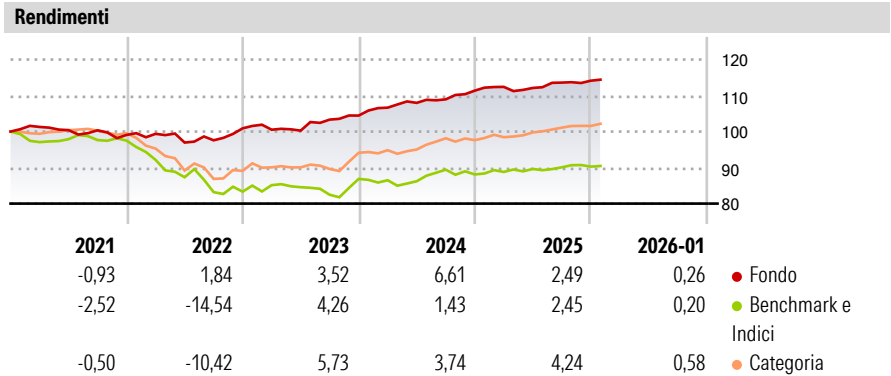


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund S - EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Flessibili Globali - EUR Hedged	Morningstar Global Core Bond GR Hedged EUR 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	0,91	3Y Sharpe Ratio	0,46
3Y Beta	-0,17	3Y Std Dev	2,30
3Y R-Squared	9,38	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,37	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	5,30	10Y Risk	-Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,73	-0,23	0,68	2026	-	-	-	-
6-Mesi	1,75	1,30	2,26	2025	0,95	-0,27	1,32	0,47
1-Anno	2,23	2,37	4,57	2024	2,10	1,25	0,90	2,21
3-Anni Ann.ti	4,05	2,09	3,86	2023	-0,37	-0,26	3,05	1,10
5-Anni Ann.ti	2,60	-1,85	0,25	2022	0,30	-2,43	0,65	3,40
10-Anni Ann.ti	2,37	0,01	1,29					

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity 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)	64,27 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	(30/01/2026)	-	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,74%
Data di Partenza	17/12/2013	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,74%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Acc		
NAV (30/01/2026)	EUR 124,37	ISIN	LU0968473354		
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR				

(31/12/2025)