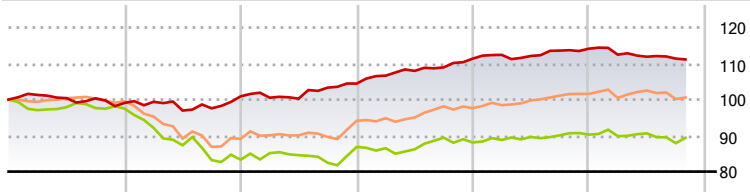
# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund S - EUR

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Obbligazionari Flessibili Globali - EUR Hedged | Morningstar Global Core Bond GR Hedged EUR<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 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| -0,93 | 1,84 | 3,52 | 6,61 | 2,49 | -2,61 | Fondo |
| -2,52 | -14,54 | 4,26 | 1,43 | 2,45 | -0,98 | Benchmark e Indici |
| -0,50 | -10,42 | 5,73 | 3,74 | 4,24 | -0,93 | Categoria |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -0,31 | 3Y Sharpe Ratio | -0,16 |
| 3Y Beta | 0,00 | 3Y Std Dev | 2,11 |
| 3Y R-Squared | 0,00 | 3Y Risk | Basso |
| 3Y Info Ratio | -0,14 | 5Y Risk | -Med |
| 3Y Tracking Error | 4,54 | 10Y Risk | -Med |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -1,02 | -0,09 | -1,33 |
| 6-Mesi | -1,36 | -0,41 | -0,92 |
| 1-Anno | -2,42 | -0,74 | -0,42 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,19 | 2,72 | 3,97 |
| 5-Anni Ann.ti | 2,20 | -1,79 | 0,03 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,08 | -0,27 | 0,75 |

Rendimenti aggiornati al 06/11/2026

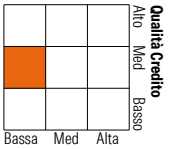
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -1,45 | -0,51 | -0,48 | - |
| 2025 | 0,95 | -0,27 | 1,32 | 0,47 |
| 2024 | 2,10 | 1,25 | 0,90 | 2,21 |
| 2023 | -0,37 | -0,26 | 3,05 | 1,10 |
| 2022 | 0,30 | -2,43 | 0,65 | 3,40 |

## 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. | Patrimonio Classe (Mln) (06/11/2026) | 50,96 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Valuta del Fondo | EUR | T.E.R. | 0,74% |
| Data di Partenza | 17/12/2013 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,74% |
| Nome del Gestore | Mark Dowding<br>Marc Stacey<br>Thomas Moulds<br>Russel Matthews<br>Russell Vincent | Inc/Acc | Acc | Commissione di incentivo | - |
| | | ISIN | LU0968473354 | | |
| Data Inizio Gestione | 01/04/2025 | | | | |
| NAV (06/11/2026) | EUR 120,60 | | | | |

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.

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

| | |
|---|---|
| Patrimonio Netto (Mln) | 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.