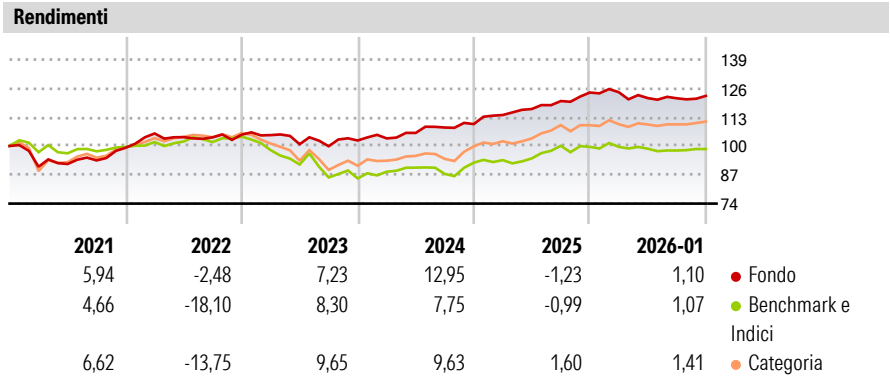


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund C - GBP

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

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	0,63	3Y Sharpe Ratio	0,73
3Y Beta	-0,17	3Y Std Dev	4,19
3Y R-Squared	9,59	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,32	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	5,31	10Y Risk	-Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,62	1,58	2,72	2026	-	-	-	-
6-Mesi	2,30	2,08	3,12	2025	0,12	-2,15	-0,07	0,90
1-Anno	0,40	0,82	3,53	2024	3,72	2,36	3,09	3,21
3-Anni Ann.ti	5,90	4,37	6,07	2023	0,93	2,38	2,30	1,44
5-Anni Ann.ti	4,17	-0,09	2,26	2022	-0,17	-3,93	-0,89	2,60
10-Anni Ann.ti	1,90	-0,06	1,67					

Rendimenti aggiornati al 30/01/2026

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)	5,53 GBP
Telefono	-	(30/01/2026)	
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO
Data di Partenza	20/05/2014	Valuta del Fondo	GBP
Nome del Gestore	-	UCITS	Si
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Acc
NAV (30/01/2026)	GBP 132,64	ISIN	LU0842208091
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
(31/12/2025)		Investimento Min. Successivo	-
		T.E.R.	0,94%
		Spese correnti	0,94%
		Commissione di incentivo	-