

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

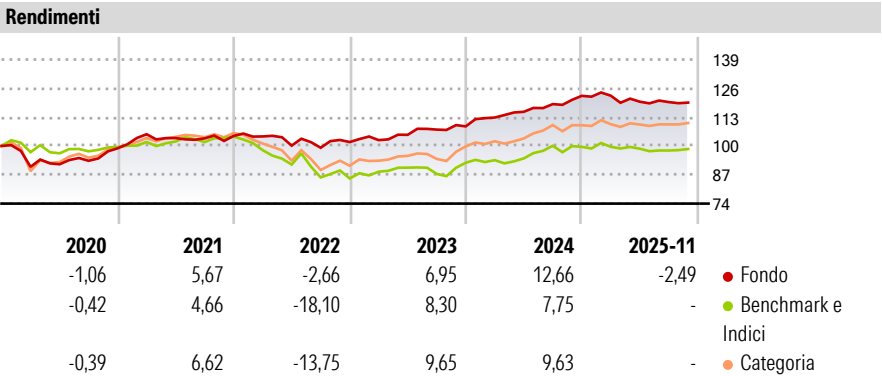
Categoria Morningstar™  
(QIDiv)

Benchmark Morningstar  
Morningstar Global Core Bond GR Hedged  
GBP  
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato  
ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR LOC

Morningstar Rating™  
Senza rating

**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	0,88	3Y Sharpe Ratio	0,53
3Y Beta	-0,17	3Y Std Dev	4,28
3Y R-Squared	10,24	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	0,30	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	5,65	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,30	1,92	2,97	2026	-	-	-	-
6-Mesi	-0,65	2,92	4,52	2025	0,05	-2,21	-0,14	-
1-Anno	-2,19	0,46	3,29	2024	3,66	2,29	3,01	3,14
3-Anni Ann.ti	4,99	4,96	6,71	2023	0,86	2,33	2,23	1,37
5-Anni Ann.ti	4,59	-0,05	2,24	2022	-0,23	-3,98	-0,96	2,60
10-Anni Ann.ti	0,74	-0,11	1,68					

Rendimenti aggiornati al 11/12/2025

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
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)	0,07 GBP	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	(11/12/2025)	-	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,20%
Data di Partenza	21/06/2011	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	1,20%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Inc		
NAV (11/12/2025)	GBP 113,36	ISIN	LU0627763310		
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR				

(31/12/2025)