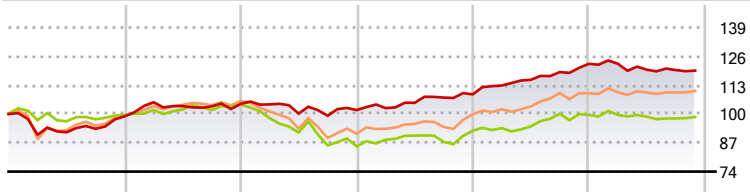
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund D - GBP

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

Rendimenti



	2020	2021	2022	2023	2024	2025-11
Fondo	-1,06	5,67	-2,66	6,95	12,66	-2,49
Benchmark e Indici	-0,42	4,66	-18,10	8,30	7,75	-
Categoria	-0,39	6,62	-13,75	9,65	9,63	-

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
3-Mesi	-0,30	1,57	1,15
6-Mesi	-0,65	3,59	5,03
1-Anno	-2,19	5,63	13,54
3-Anni Ann.ti	4,99	5,64	7,33
5-Anni Ann.ti	4,59	0,11	1,98
10-Anni Ann.ti	0,74	1,26	2,73

Rendimenti aggiornati al 11/12/2025

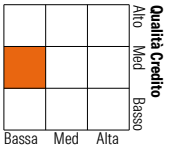
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	0,05	-2,21	-0,14	-
2024	3,66	2,29	3,01	3,14
2023	0,86	2,33	2,23	1,37
2022	-0,23	-3,98	-0,96	2,60

Portafoglio 30/09/2026



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

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	21/06/2011
Nome del Gestore	Mark Dowding Marc Stacey Thomas Moulds Russel Matthews Russell Vincent
Data Inizio Gestione	01/04/2025
NAV (11/12/2025)	GBP 113,36
Patrimonio Classe (Mln) (11/12/2025)	0,07 GBP
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBP
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU0627763310
Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	1,20%
Spese correnti	1,20%
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 D - GBP (QIDiv)

Patrimonio Netto (MIn)	857,43 EUR
Report Date	

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.