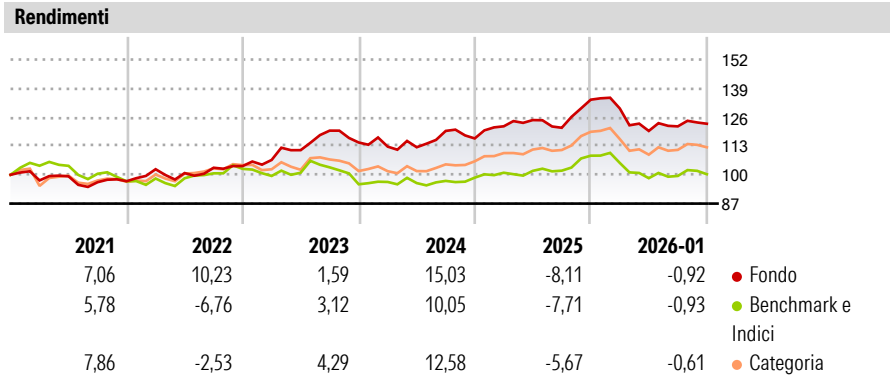


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund B - USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Global Flexible Bond - USD Hedged	Morningstar Global Core Bond GR Hedged USD 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	0,48	3Y Sharpe Ratio	-0,04
3Y Beta	-0,16	3Y Std Dev	8,04
3Y R-Squared	8,81	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,26	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	5,31	10Y Risk	-Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,78	-2,33	-1,60	2026	-	-	-	-
6-Mesi	0,15	0,21	1,11	2025	-2,94	-7,82	1,73	0,97
1-Anno	-10,12	-9,35	-7,44	2024	4,71	2,31	-2,79	10,45
3-Anni Ann.ti	1,89	0,84	2,37	2023	-1,63	-0,25	6,56	-2,84
5-Anni Ann.ti	4,12	0,53	2,52	2022	2,66	4,13	7,93	-4,46
10-Anni Ann.ti	3,48	1,37	3,07					

Rendimenti aggiornati al 09/02/2026

Portafoglio 31/12/2025				Fixed Income Style				Credit Quality %			
	Asset Allocation %	Netta		Box™	Duration Effettiva	Fondo		Fond	Credit Quality %	Fond	
	● Azioni	0,00			Maturità effettiva	10,65		AAA	20,81	BBB	41,63
	● Obbligazioni	113,45			Qualità Credito Media	BBB		AA	0,84	BB	13,70
	● Liquidità	-13,81						A	22,99	B	0,00
	● Altro	0,35								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)	3,21 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	(09/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,20%
Data di Partenza	17/05/2012	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,20%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Acc		
NAV (09/02/2026)	USD 161,23	ISIN	LU0627762262		
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR				
(31/12/2025)					