

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

Categoria Morningstar™

Global Flexible Bond - USD Hedged

Benchmark Morningstar

Morningstar Global Core Bond GR Hedged

USD

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR LOC

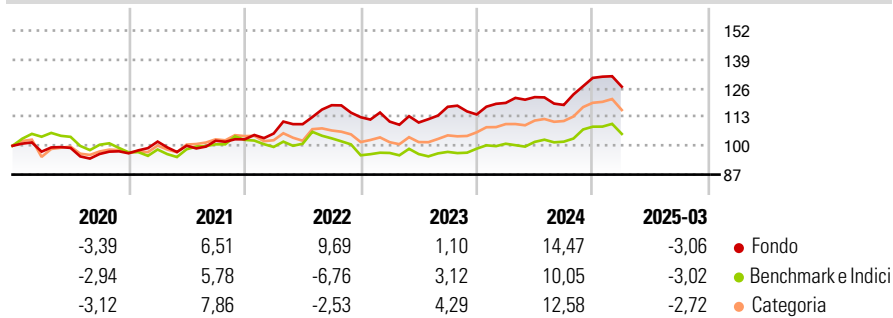
Morningstar Rating™

★★★★

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



Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 0,62 | 3Y Sharpe Ratio | 0,49 |
| 3Y Beta | 0,00 | 3Y Std Dev | 7,88 |
| 3Y R-Squared | 0,01 | 3Y Risk | -Med |
| 3Y Info Ratio | 0,65 | 5Y Risk | -Med |
| 3Y Tracking Error | 6,66 | 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 | -9,88 | -7,85 | -8,42 | 2025 | -3,06 | - | - | - |
| 6-Mesi | -3,17 | -3,68 | -3,91 | 2024 | 4,58 | 2,19 | -2,89 | 10,31 |
| 1-Anno | -2,55 | -0,58 | -0,30 | 2023 | -1,75 | -0,37 | 6,42 | -2,95 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,78 | -0,01 | 1,44 | 2022 | 2,54 | 4,00 | 7,79 | -4,57 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,77 | -1,04 | 1,81 | 2021 | 5,46 | -1,82 | 2,24 | 0,62 |
| 10-Anni Ann.ti | 1,89 | 1,17 | 2,14 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 16/04/2025

Portafoglio 28/02/2025



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|--------|
| Azioni | 0,00 |
| Obbligazioni | -12,71 |
| Liquidità | 111,83 |
| Altro | 0,89 |

Fixed Income Style Box™

| Qualità Credito | Bassa | Med | Alta |
|-----------------|-------|-----|------|
| Alto | | | |
| Med | | | |
| Basso | | | |

Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Fondo

Credit Quality %

Fond

Credit Quality %

Fond

| | | | |
|-----|-------|-----------|-------|
| AAA | 10,26 | BBB | 55,84 |
| AA | 2,13 | BB | 11,01 |
| A | 20,72 | B | 0,00 |
| | | Below B | 0,00 |
| | | Not Rated | 0,05 |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| 2 Year Treasury Note Future... | — | 15,54 |
| Mexico (United Mexican... | — | 5,80 |
| Germany (Federal Republic... | — | 4,78 |
| Germany (Federal Republic... | — | 3,03 |
| Japan (Government Of) 2.2% | — | 1,91 |
| Mexico (United Mexican... | — | 1,73 |
| Romania (Republic Of) 2.625% | — | 1,04 |
| Autostrade per l'Italia... | — | 1,03 |
| UBS Group AG 2.875% | — | 1,01 |
| Germany (Federal Republic... | — | 0,94 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 36,80 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 238 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|----------------------------|--------|
| 🏛️ Governativo | -28,02 |
| 🏢 Societario | 51,90 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 0,00 |
| 🏘️ Enti Locali | 0,00 |
| 🏦 Liquidità ed equivalenti | 133,95 |
| 📄 Derivati | -57,84 |

Coupon Range %

| | Fondo |
|-------------------|-------|
| 0 coupon | 1,10 |
| Da 0 a 4 cedole | 41,95 |
| Da 4 a 6 cedole | 40,97 |
| Da 6 a 8 cedole | 10,03 |
| Da 8 a 10 cedole | 5,96 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 16,93 |
| da 3 a 5 | 10,20 |
| da 5 a 7 | 13,48 |
| da 7 a 10 | 19,05 |
| da 10 a 15 | 8,16 |
| da 15 a 20 | 5,28 |
| da 20 a 30 | 5,86 |
| oltre 30 | 4,37 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 261,79 USD | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | - | (01/12/2014) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 1,70% |
| Data di Partenza | 05/07/2012 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 1,70% |
| Nome del Gestore | Andrzej Skiba | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 01/12/2016 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (16/04/2025) | USD 142,30 | ISIN | LU0627762429 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.148,15 EUR | | | | |

(28/02/2025)