

**BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund C - GBP (AIDiv)**

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			Senza rating																																																																																																																														
Usato nel Report																																																																																																																																	
<strong>Obiettivo d'Investimento Dichiarato</strong>	<strong>Rendimenti</strong>																																																																																																																																
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.	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Anno</th> <th>Fondo</th> <th>Benchmark e Indici</th> <th>Categoria</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2019</td> <td>12,00</td> <td>12,62</td> <td>12,00</td> </tr> <tr> <td>2020</td> <td>-0,81</td> <td>-0,42</td> <td>-0,42</td> </tr> <tr> <td>2021</td> <td>5,94</td> <td>4,66</td> <td>4,66</td> </tr> <tr> <td>2022</td> <td>-2,44</td> <td>-18,10</td> <td>-18,10</td> </tr> <tr> <td>2023</td> <td>7,23</td> <td>8,30</td> <td>8,30</td> </tr> <tr> <td>2024-12</td> <td>12,96</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> </tbody> </table>			Anno	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria	2019	12,00	12,62	12,00	2020	-0,81	-0,42	-0,42	2021	5,94	4,66	4,66	2022	-2,44	-18,10	-18,10	2023	7,23	8,30	8,30	2024-12	12,96	-	-																																																																																																		
Anno	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria																																																																																																																														
2019	12,00	12,62	12,00																																																																																																																														
2020	-0,81	-0,42	-0,42																																																																																																																														
2021	5,94	4,66	4,66																																																																																																																														
2022	-2,44	-18,10	-18,10																																																																																																																														
2023	7,23	8,30	8,30																																																																																																																														
2024-12	12,96	-	-																																																																																																																														
<strong>Misure di Rischio</strong>	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Misura</th> <th>Valore</th> <th>Unità</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>3Y Alpha</td> <td>1,37</td> <td>3Y Sharpe Ratio</td> <td>0,68</td> </tr> <tr> <td>3Y Beta</td> <td>-0,02</td> <td>3Y Std Dev</td> <td>5,24</td> </tr> <tr> <td>3Y R-Squared</td> <td>0,12</td> <td>3Y Risk</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>3Y Info Ratio</td> <td>1,04</td> <td>5Y Risk</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>3Y Tracking Error</td> <td>6,94</td> <td>10Y Risk</td> <td>-</td> </tr> </tbody> </table> <p>Basati su Morningstar Global Core Bond GR Hedged GBP (dove applicabile)</p>			Misura	Valore	Unità	3Y Alpha	1,37	3Y Sharpe Ratio	0,68	3Y Beta	-0,02	3Y Std Dev	5,24	3Y R-Squared	0,12	3Y Risk	-	3Y Info Ratio	1,04	5Y Risk	-	3Y Tracking Error	6,94	10Y Risk	-																																																																																																							
Misura	Valore	Unità																																																																																																																															
3Y Alpha	1,37	3Y Sharpe Ratio	0,68																																																																																																																														
3Y Beta	-0,02	3Y Std Dev	5,24																																																																																																																														
3Y R-Squared	0,12	3Y Risk	-																																																																																																																														
3Y Info Ratio	1,04	5Y Risk	-																																																																																																																														
3Y Tracking Error	6,94	10Y Risk	-																																																																																																																														
<strong>Portafoglio 31/12/2025</strong>	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Asset Allocation %</th> <th>Netta</th> <th>Fixed Income Style Box™</th> <th>Rend. Cumulati %</th> <th>Rendimenti Trimestrali %</th> <th>Q1</th> <th>Q2</th> <th>Q3</th> <th>Q4</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Azioni</td> <td>0,00</td> <td>Box: Bassa Qualità Creditio</td> <td>3-Mesi</td> <td>12,00</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Obbligazioni</td> <td>113,45</td> <td>Box: Alta Qualità Creditio</td> <td>6-Mesi</td> <td>12,62</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Liquidità</td> <td>-13,81</td> <td>Box: Medio Qualità Creditio</td> <td>1-Anno</td> <td>14,53</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Altro</td> <td>0,35</td> <td>Box: Alta Qualità Creditio</td> <td>3-Anni Ann.ti</td> <td>-0,39</td> <td>3,73</td> <td>2,36</td> <td>3,09</td> <td>3,20</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>Box: Medio Qualità Creditio</td> <td>5-Anni Ann.ti</td> <td>6,62</td> <td>0,93</td> <td>2,38</td> <td>2,30</td> <td>1,44</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>Box: Bassa Qualità Creditio</td> <td>10-Anni Ann.ti</td> <td>-13,75</td> <td>-0,19</td> <td>-3,92</td> <td>-0,89</td> <td>2,65</td> </tr> </tbody> </table> <p>Rendimenti aggiornati al 03/01/2025</p>			Asset Allocation %	Netta	Fixed Income Style Box™	Rend. Cumulati %	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4	Azioni	0,00	Box: Bassa Qualità Creditio	3-Mesi	12,00	-	-	-	-	Obbligazioni	113,45	Box: Alta Qualità Creditio	6-Mesi	12,62	-	-	-	-	Liquidità	-13,81	Box: Medio Qualità Creditio	1-Anno	14,53	-	-	-	-	Altro	0,35	Box: Alta Qualità Creditio	3-Anni Ann.ti	-0,39	3,73	2,36	3,09	3,20			Box: Medio Qualità Creditio	5-Anni Ann.ti	6,62	0,93	2,38	2,30	1,44			Box: Bassa Qualità Creditio	10-Anni Ann.ti	-13,75	-0,19	-3,92	-0,89	2,65																																																															
Asset Allocation %	Netta	Fixed Income Style Box™	Rend. Cumulati %	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4																																																																																																																									
Azioni	0,00	Box: Bassa Qualità Creditio	3-Mesi	12,00	-	-	-	-																																																																																																																									
Obbligazioni	113,45	Box: Alta Qualità Creditio	6-Mesi	12,62	-	-	-	-																																																																																																																									
Liquidità	-13,81	Box: Medio Qualità Creditio	1-Anno	14,53	-	-	-	-																																																																																																																									
Altro	0,35	Box: Alta Qualità Creditio	3-Anni Ann.ti	-0,39	3,73	2,36	3,09	3,20																																																																																																																									
		Box: Medio Qualità Creditio	5-Anni Ann.ti	6,62	0,93	2,38	2,30	1,44																																																																																																																									
		Box: Bassa Qualità Creditio	10-Anni Ann.ti	-13,75	-0,19	-3,92	-0,89	2,65																																																																																																																									
<strong>Titoli principali</strong>	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Nome</th> <th>Settore</th> <th>%</th> <th>Fixed Income Sector Weightings %</th> <th>Fondo</th> <th>Credit Quality %</th> <th>Fond o</th> <th>Credit Quality %</th> <th>Fond o</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Germany (Federal Republic...</td> <td>-</td> <td>9,63</td> <td>Governativo</td> <td>96,16</td> <td>AAA</td> <td>20,81</td> <td>BBB</td> <td>41,63</td> </tr> <tr> <td>Colombia (Republic Of) 13,25%</td> <td>-</td> <td>2,32</td> <td>Societario</td> <td>50,05</td> <td>AA</td> <td>0,84</td> <td>BB</td> <td>13,70</td> </tr> <tr> <td>Mexico (United Mexican...)</td> <td>-</td> <td>2,30</td> <td>Cartolarizzazioni</td> <td>0,00</td> <td>A</td> <td>22,99</td> <td>B</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>Japan (Government Of) 2,2%</td> <td>-</td> <td>2,15</td> <td>Enti Locali</td> <td>0,00</td> <td></td> <td></td> <td>Below B</td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>Ministerio de Hacienda y...</td> <td>-</td> <td>2,03</td> <td>Liquidità ed equivalenti</td> <td>11,11</td> <td></td> <td></td> <td>Not Rated</td> <td>0,03</td> </tr> <tr> <td>Romania (Republic Of) 6,125%</td> <td>-</td> <td>1,83</td> <td>Derivati</td> <td>-57,32</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Mexico (United Mexican...)</td> <td>-</td> <td>1,43</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Germany (Federal Republic...</td> <td>-</td> <td>1,31</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>South Africa (Republic of)...</td> <td>-</td> <td>1,27</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Germany (Federal Republic...</td> <td>-</td> <td>1,26</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>% Primi 10 Titoli sul Patrimonio</td> <td>25,54</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Numero Complessivo di Titoli Azionari</td> <td>0</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari</td> <td>235</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>			Nome	Settore	%	Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Credit Quality %	Fond o	Credit Quality %	Fond o	Germany (Federal Republic...	-	9,63	Governativo	96,16	AAA	20,81	BBB	41,63	Colombia (Republic Of) 13,25%	-	2,32	Societario	50,05	AA	0,84	BB	13,70	Mexico (United Mexican...)	-	2,30	Cartolarizzazioni	0,00	A	22,99	B	0,00	Japan (Government Of) 2,2%	-	2,15	Enti Locali	0,00			Below B	0,00	Ministerio de Hacienda y...	-	2,03	Liquidità ed equivalenti	11,11			Not Rated	0,03	Romania (Republic Of) 6,125%	-	1,83	Derivati	-57,32					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							
Nome	Settore	%	Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Credit Quality %	Fond o	Credit Quality %	Fond o																																																																																																																									
Germany (Federal Republic...	-	9,63	Governativo	96,16	AAA	20,81	BBB	41,63																																																																																																																									
Colombia (Republic Of) 13,25%	-	2,32	Societario	50,05	AA	0,84	BB	13,70																																																																																																																									
Mexico (United Mexican...)	-	2,30	Cartolarizzazioni	0,00	A	22,99	B	0,00																																																																																																																									
Japan (Government Of) 2,2%	-	2,15	Enti Locali	0,00			Below B	0,00																																																																																																																									
Ministerio de Hacienda y...	-	2,03	Liquidità ed equivalenti	11,11			Not Rated	0,03																																																																																																																									
Romania (Republic Of) 6,125%	-	1,83	Derivati	-57,32																																																																																																																													
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																																																																																																																																
<strong>Anagrafica</strong>	<table border="1"> <thead> <tr> <th>Società di Gestione</th> <th>BlueBay Funds Management Company S.A.</th> <th>Patrimonio Classe (Mln)</th> <th>38,78 GBP</th> <th>Investimento Min. Ingresso</th> <th>10.000 EUR</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Telefono</td> <td>-</td> <td>(01/12/2014)</td> <td></td> <td>Investimento Min. Successivo</td> <td></td> </tr> <tr> <td>Web</td> <td>www.bluebayinvest.com</td> <td>Domicilio</td> <td>LUSSEMBURGO</td> <td>T.E.R.</td> <td>0,94%</td> </tr> <tr> <td>Data di Partenza</td> <td>22/01/2013</td> <td>Valuta del Fondo</td> <td>GBP</td> <td>Spese correnti</td> <td>0,94%</td> </tr> <tr> <td>Nome del Gestore</td> <td>-</td> <td>UCITS</td> <td>Si</td> <td>Commissione di incentivo</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Data Inizio Gestione</td> <td>01/04/2025</td> <td>Inc/Acc</td> <td>Inc</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>NAV (03/01/2025)</td> <td>GBP 104,39</td> <td>ISIN</td> <td>LU0842207796</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Patrimonio Netto (Mln)</td> <td>1.360,49 EUR</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>(31/12/2025)</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>			Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	38,78 GBP	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR	Telefono	-	(01/12/2014)		Investimento Min. Successivo		Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,94%	Data di Partenza	22/01/2013	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	0,94%	Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-	Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Inc			NAV (03/01/2025)	GBP 104,39	ISIN	LU0842207796			Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR					(31/12/2025)																																																																													
Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	38,78 GBP	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR																																																																																																																												
Telefono	-	(01/12/2014)		Investimento Min. Successivo																																																																																																																													
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,94%																																																																																																																												
Data di Partenza	22/01/2013	Valuta del Fondo	GBP	Spese correnti	0,94%																																																																																																																												
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-																																																																																																																												
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Inc																																																																																																																														
NAV (03/01/2025)	GBP 104,39	ISIN	LU0842207796																																																																																																																														
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR																																																																																																																																
(31/12/2025)																																																																																																																																	

© 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 perduto 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.