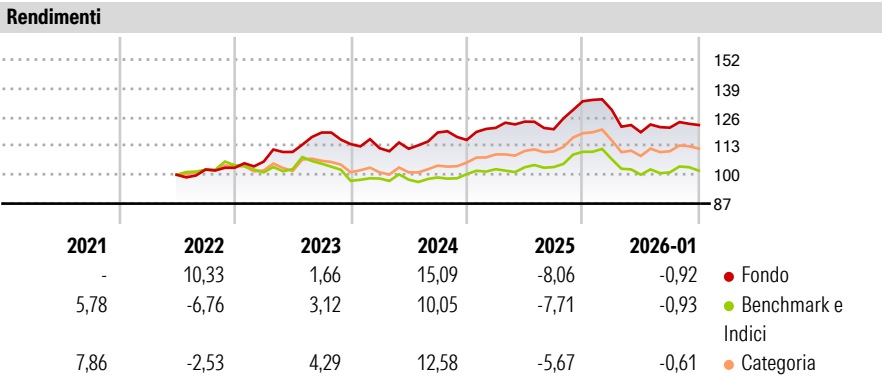


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund M - USD

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	0,54	3Y Sharpe Ratio	-0,03
3Y Beta	-0,16	3Y Std Dev	8,04
3Y R-Squared	8,84	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,27	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	5,31	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-1,77	-2,33	-1,60	2026	-	-	-	-
6-Mesi	0,18	0,21	1,11	2025	-2,93	-7,81	1,75	0,97
1-Anno	-10,07	-9,35	-7,44	2024	4,73	2,31	-2,77	10,47
3-Anni Ann.ti	1,95	0,84	2,37	2023	-1,61	-0,23	6,58	-2,83
5-Anni Ann.ti	-	0,53	2,52	2022	2,67	4,14	7,94	-4,40
10-Anni Ann.ti	-	1,37	3,07					

Rendimenti aggiornati al 09/02/2026

Portafoglio 31/12/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	113,45
Liquidità	-13,81
Altro	0,35

Fixed Income Style Box™

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			Fixed Income Sector Weightings %		Fondo	Scadenze %		Fondo
Nome	Settore	%						
Germany (Federal Republic...	—	9,63	Governativo		96,16	da 1 a 3		59,80
Colombia (Republic Of) 13.25%	—	2,32	Societario		50,05	da 3 a 5		4,89
Mexico (United Mexican...	—	2,30	Cartolarizzazioni		0,00	da 5 a 7		7,75
Japan (Government Of) 2.2%	—	2,15	Enti Locali		0,00	da 7 a 10		10,68
Ministerio de Hacienda y...	—	2,03	Liquidità ed equivalenti		11,11	da 10 a 15		6,08
Romania (Republic Of) 6.125%	—	1,83	Derivati		-57,32	da 15 a 20		1,37
Mexico (United Mexican...	—	1,43				da 20 a 30		5,70
Germany (Federal Republic...	—	1,31				oltre 30		2,32
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						

Anagrafica			
Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	3,52 USD
Telefono	-	(09/02/2026)	
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO
Data di Partenza	22/05/2013	Valuta del Fondo	USD
Nome del Gestore	-	UCITS	Si
Data Inizio Gestione	01/04/2025	Inc/Acc	Acc
NAV (09/02/2026)	USD 121,62	ISIN	LU0720469435
Patrimonio Netto (Mln)	1.360,49 EUR		
(31/12/2025)			
		Investimento Min. Ingresso	-
		Investimento Min. Successivo	-
		T.E.R.	1,14%
		Spese correnti	1,14%
		Commissione di incentivo	-