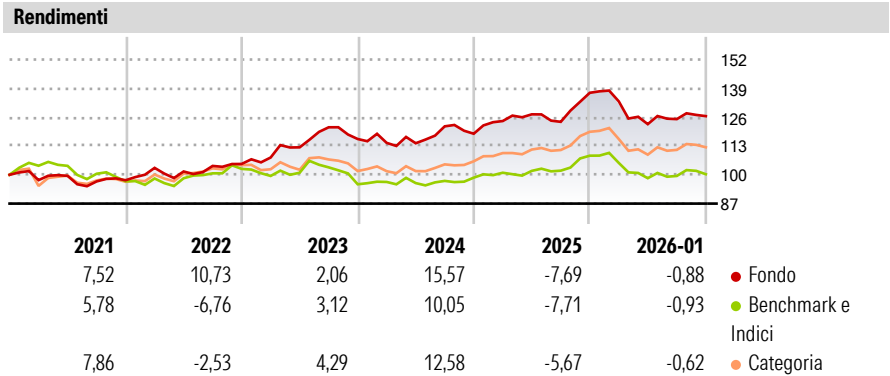


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund S - USD

| | | | |
|-----------------------------------|--|--------------------------------------|----------------------------|
| 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 | 0,95 | 3Y Sharpe Ratio | 0,02 |
| 3Y Beta | -0,16 | 3Y Std Dev | 8,04 |
| 3Y R-Squared | 8,84 | 3Y Risk | -Med |
| 3Y Info Ratio | 0,35 | 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 | -0,95 | -2,22 | -1,29 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 0,50 | -0,32 | 1,10 | 2025 | -2,84 | -7,71 | 1,85 | 1,08 |
| 1-Anno | -8,08 | -8,89 | -6,65 | 2024 | 4,83 | 2,42 | -2,66 | 10,58 |
| 3-Anni Ann.ti | 3,50 | 1,12 | 2,82 | 2023 | -1,52 | -0,13 | 6,67 | -2,72 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,78 | 0,38 | 2,47 | 2022 | 2,77 | 4,25 | 8,05 | -4,36 |
| 10-Anni Ann.ti | 3,57 | 1,31 | 2,91 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 31/12/2025

Asset Allocation %

- Azioni: 0,00
- Obbligazioni: 113,45
- Liquidità: -13,81
- Altro: 0,35

Fixed Income Style Box™

Qualità Credito: Alto, Med, Basso

Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta

Duration Effettiva: -

Maturità effettiva: 10,65

Qualità Credito Media: BBB

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) | 9,21 USD |
| Telefono | - | (02/02/2026) | |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Data di Partenza | 27/01/2014 | Valuta del Fondo | USD |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si |
| Data Inizio Gestione | 01/04/2025 | Inc/Acc | Acc |
| NAV (02/02/2026) | USD 151,00 | ISIN | LU0968473511 |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.360,49 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| (31/12/2025) | | Investimento Min. Successivo | - |
| | | T.E.R. | 0,74% |
| | | Spese correnti | 0,74% |
| | | Commissione di incentivo | - |