

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

**Categoria Morningstar™**  
**(AIDiv)**  
Global Core Bond - USD Hedged

**Benchmark Morningstar**  
Morningstar Global Core Bond GR Hedged  
USD

**Benchmark Dichiarato**  
ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR LOC

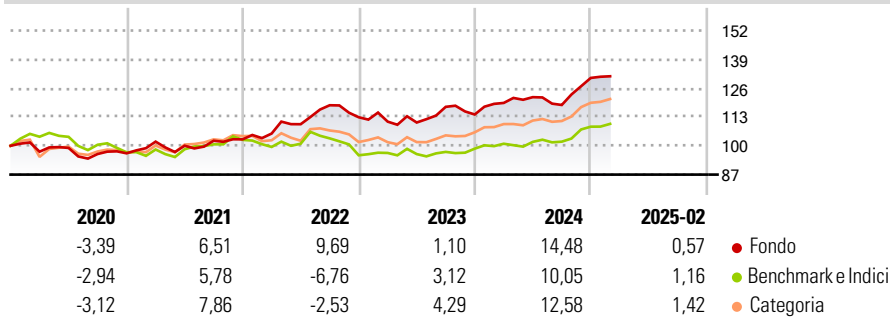
**Morningstar Rating™**  
Senza rating

Usato nel Report

## 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

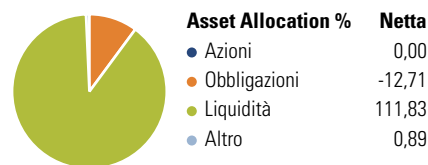
3Y Alpha	0,96	3Y Sharpe Ratio	0,77
3Y Beta	-0,02	3Y Std Dev	7,52
3Y R-Squared	0,20	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	0,76	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	6,86	10Y Risk	-

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-2,46	-7,85	-8,42	2025	-	-	-	-
6-Mesi	7,31	-3,68	-3,91	2024	4,58	2,18	-2,89	10,32
1-Anno	6,03	-0,58	-0,30	2023	-1,75	-0,37	6,42	-2,95
3-Anni Ann.ti	5,67	-0,01	1,44	2022	2,55	3,99	7,79	-4,58
5-Anni Ann.ti	5,63	-1,04	1,81	2021	5,45	-1,81	2,24	0,62
10-Anni Ann.ti	2,65	1,17	2,14					

Rendimenti aggiornati al 28/03/2025

## Portafoglio 28/02/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Duration Effettiva	-	AAA	10,26	BBB	55,84
Maturity effettiva	3,18	AA	2,13	BB	11,01
Qualità Credito Media	BBB	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	Scadenze %	Fondo
🏛️ Governativo	-28,02	da 1 a 3	16,93
🏠 Societario	51,90	da 3 a 5	10,20
🏢 Cartolarizzazioni	0,00	da 5 a 7	13,48
🏛️ Enti Locali	0,00	da 7 a 10	19,05
🏠 Liquidità ed equivalenti	133,95	da 10 a 15	8,16
📄 Derivati	-57,84	da 15 a 20	5,28
		da 20 a 30	5,86
		oltre 30	4,37
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>		
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		

## Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	5,99 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	14/03/2014	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	Inc		
NAV (28/03/2025)	USD 104,71	ISIN	LU0627762692		
Patrimonio Netto (Mln)	1.148,15 EUR				

(28/02/2025)