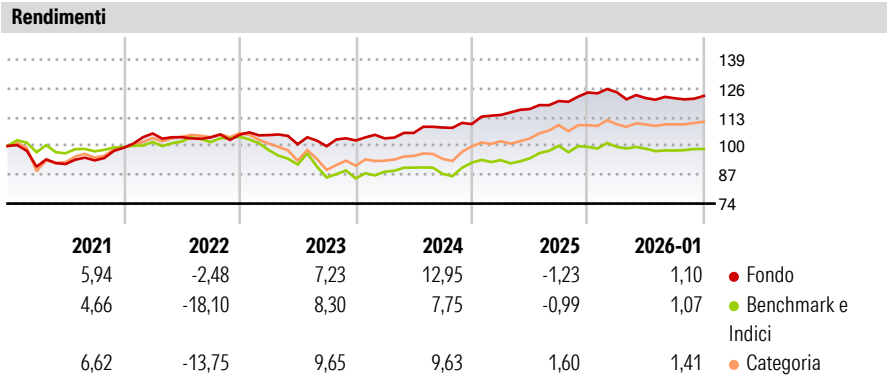


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund C - GBP

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
	Morningstar Global Core Bond GR Hedged GBP	ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR LOC	★★★★
	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.



Misure di Rischio			
3Y Alpha	0,63	3Y Sharpe Ratio	0,73
3Y Beta	-0,17	3Y Std Dev	4,19
3Y R-Squared	9,59	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	0,32	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	5,31	10Y Risk	-Med

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	2,66	1,92	2,97	2026	-	-	-	-
6-Mesi	3,05	2,92	4,52	2025	0,12	-2,15	-0,07	0,90
1-Anno	0,40	0,46	3,29	2024	3,72	2,36	3,09	3,21
3-Anni Ann.ti	6,52	4,96	6,71	2023	0,93	2,38	2,30	1,44
5-Anni Ann.ti	4,12	-0,05	2,24	2022	-0,17	-3,93	-0,89	2,60
10-Anni Ann.ti	1,87	-0,11	1,68					

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

Portafoglio 31/12/2025																	
	Asset Allocation %		Netta	Fixed Income Style			Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond						
	● Azioni		0,00	Box™			-		0		0						
	● Obbligazioni		113,45	<table><tr><td colspan="3" rowspan="4"></td><td rowspan="4">Qualità Credito</td></tr><tr><td rowspan="4">Alto</td></tr><tr><td rowspan="4">Med</td></tr><tr><td rowspan="4">Basso</td></tr></table>						Qualità Credito	Alto	Med	Basso	Duration Effettiva			
														Qualità Credito			
															Alto		
																Med	
				Basso													
	● Liquidità		-13,81			Maturità effettiva	10,65										
	● Altro		0,35			Qualità Credito Media	BBB	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								