

# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - Q - CHF

Categoria Morningstar™  
**accumulating**

Benchmark Morningstar

Morningstar Global Core Bond GR Hedged

CHF

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR LOC

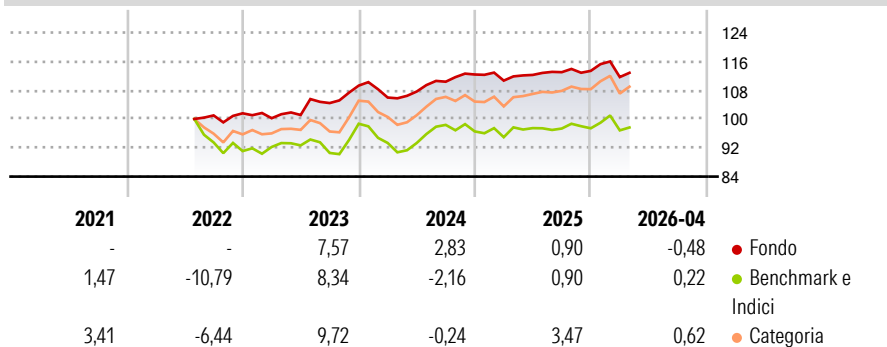
Morningstar Rating™

★★★

## 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

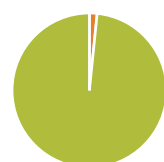
|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 0,54  | 3Y Sharpe Ratio | 0,16 |
| 3Y Beta           | -0,03 | 3Y Std Dev      | 4,79 |
| 3Y R-Squared      | 0,21  | 3Y Risk         | -Med |
| 3Y Info Ratio     | 0,44  | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | 4,76  | 10Y Risk        | -    |

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

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2   | Q3   | Q4   |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|------|------|------|
| 3-Mesi           | -2,62 | -2,41 | -2,14 | 2026                     | -1,52 | -    | -    | -    |
| 6-Mesi           | -0,94 | -1,42 | -0,32 | 2025                     | -1,51 | 1,43 | 0,68 | 0,32 |
| 1-Anno           | 1,51  | 1,25  | 3,68  | 2024                     | -3,03 | 1,58 | 2,53 | 1,82 |
| 3-Anni Ann.ti    | 3,45  | 1,23  | 3,20  | 2023                     | -1,34 | 0,90 | 3,27 | 4,63 |
| 5-Anni Ann.ti    | -     | 0,32  | 1,87  | 2022                     | -     | -    | -    | 0,58 |
| 10-Anni Ann.ti   | -     | 0,48  | 1,90  |                          |       |      |      |      |

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

## Portafoglio 31/03/2026



| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni           | 0,00  |
| ● Obbligazioni     | 1,61  |
| ● Liquidità        | 98,39 |
| ● Altro            | 0,00  |

## Fixed Income Style

### Box™

|                      |       | Qualità Credito |     |       |
|----------------------|-------|-----------------|-----|-------|
|                      |       | Alto            | Med | Basso |
| Sensibilità ai Tassi | Alto  |                 |     |       |
|                      | Med   |                 |     |       |
|                      | Basso |                 |     |       |

|                       |       |
|-----------------------|-------|
| 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

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Germany (Federal Republic...)               | -       | 17,13 |
| Ministerio de Hacienda y...                 | -       | 5,63  |
| Poland (Republic of) 2.875%                 | -       | 2,14  |
| Mexico (United Mexican...)                  | -       | 2,08  |
| Iceland (Republic Of) 6.5%                  | -       | 1,40  |
| Mexico (United Mexican...)                  | -       | 1,32  |
| Mexico (United Mexican...)                  | -       | 1,25  |
| Romania (Republic Of) 4.625%                | -       | 1,11  |
| Mexico (United Mexican...)                  | -       | 1,04  |
| Japan (Government Of) 0.5%                  | -       | 1,04  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 34,14 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 218   |

## Fixed Income Sector Weightings %

|                            | Fondo        |
|----------------------------|--------------|
| 🏛️ Governativo             | -10,26       |
| 🏢 Societario               | 47,66        |
| 🏠 Cartolarizzazioni        | 0,00         |
| 👤 Enti Locali              | 0,00         |
| 🏦 Liquidità ed equivalenti | -172,73      |
| 📄 Derivati                 | 235,33       |
| <b>Coupon Range %</b>      | <b>Fondo</b> |
| 0 coupon                   | 18,39        |
| Da 0 a 4 cedole            | 31,83        |
| Da 4 a 6 cedole            | 28,48        |
| Da 6 a 8 cedole            | 11,35        |
| Da 8 a 10 cedole           | 3,08         |
| Da 10 a 12 cedole          | 0,00         |
| Oltre 12 cedole            | 6,87         |

## Scadenze %

|            | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3   | 6,67  |
| da 3 a 5   | 20,80 |
| da 5 a 7   | 13,89 |
| da 7 a 10  | 14,73 |
| da 10 a 15 | 12,39 |
| da 15 a 20 | 2,12  |
| da 20 a 30 | 7,03  |
| oltre 30   | 4,72  |

## Anagrafica

|                      |                                       |                         |              |                              |       |
|----------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione  | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,07 CHF     | Investimento Min. Ingresso   | -     |
| Telefono             | -                                     | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -     |
| Web                  | www.bluebayinvest.com                 | Valuta del Fondo        | CHF          | T.E.R.                       | -     |
| Data di Partenza     | 30/07/2015                            | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 0,84% |
| Nome del Gestore     | Mark Dowding                          | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -     |
|                      | Marc Stacey                           | ISIN                    | LU1170326398 |                              |       |
|                      | Thomas Moulds                         |                         |              |                              |       |
|                      | Russel Matthews                       |                         |              |                              |       |
|                      | Russell Vincent                       |                         |              |                              |       |
| Data Inizio Gestione | 01/04/2025                            |                         |              |                              |       |
| NAV (12/05/2026)     | CHF 106,89                            |                         |              |                              |       |

# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Absolute Return Bond Fund - Q - CHF

Patrimonio Netto (Mln)  
**accumulating**

1.319,42 EUR