

# BlueBay Funds - BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund C - USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™																																																																																																																							
Category_EUCA001007	Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD Usato nel Report	No benchmark	Senza rating																																																																																																																							
<b>Obiettivo d'Investimento Dichiarato</b>																																																																																																																										
The Sub-Fund is actively managed, does not reference any benchmark and aims to achieve a total return from a portfolio of global sovereign debt (including Emerging Market Countries) through active interest rate, credit and currency management while taking into account ESG considerations. The Sub-Fund invests its net assets in global fixed income securities issued by sovereign entities globally (including Emerging Market Countries).																																																																																																																										
<p><b>Rendimenti</b></p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Anno</th> <th>Fondo</th> <th>Benchmark e Indici</th> <th>Categoria</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2016</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2017</td> <td>-5,43</td> <td>0,38</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2018</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2019</td> <td>10,26</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2020</td> <td>-5,12</td> <td>0,24</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2021-07</td> <td>-3,68</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td></td> <td>-8,44</td> <td>9,07</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td></td> <td>-</td> <td>12,38</td> <td>-9,74</td> </tr> </tbody> </table>				Anno	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria	2016	-	-	-	2017	-5,43	0,38	-	2018	-	-	-	2019	10,26	-	-	2020	-5,12	0,24	-	2021-07	-3,68	-	-		-8,44	9,07	-		-	12,38	-9,74																																																																																			
Anno	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria																																																																																																																							
2016	-	-	-																																																																																																																							
2017	-5,43	0,38	-																																																																																																																							
2018	-	-	-																																																																																																																							
2019	10,26	-	-																																																																																																																							
2020	-5,12	0,24	-																																																																																																																							
2021-07	-3,68	-	-																																																																																																																							
	-8,44	9,07	-																																																																																																																							
	-	12,38	-9,74																																																																																																																							
<p><b>Misure di Rischio</b></p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Misura</th> <th>Valore</th> <th>Unità</th> <th>Valore</th> <th>Unità</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>3Y Alpha</td> <td>-7,68</td> <td>3Y Sharpe Ratio</td> <td>-0,12</td> <td></td> </tr> <tr> <td>3Y Beta</td> <td>0,88</td> <td>3Y Std Dev</td> <td>7,40</td> <td></td> </tr> <tr> <td>3Y R-Squared</td> <td>29,16</td> <td>3Y Risk</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td>3Y Info Ratio</td> <td>-1,33</td> <td>5Y Risk</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td>3Y Tracking Error</td> <td>6,67</td> <td>10Y Risk</td> <td>-</td> <td></td> </tr> </tbody> </table> <p>Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)</p>				Misura	Valore	Unità	Valore	Unità	3Y Alpha	-7,68	3Y Sharpe Ratio	-0,12		3Y Beta	0,88	3Y Std Dev	7,40		3Y R-Squared	29,16	3Y Risk	-		3Y Info Ratio	-1,33	5Y Risk	-		3Y Tracking Error	6,67	10Y Risk	-																																																																																										
Misura	Valore	Unità	Valore	Unità																																																																																																																						
3Y Alpha	-7,68	3Y Sharpe Ratio	-0,12																																																																																																																							
3Y Beta	0,88	3Y Std Dev	7,40																																																																																																																							
3Y R-Squared	29,16	3Y Risk	-																																																																																																																							
3Y Info Ratio	-1,33	5Y Risk	-																																																																																																																							
3Y Tracking Error	6,67	10Y Risk	-																																																																																																																							
<p><b>Portafoglio 31/12/2025</b></p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Asset Allocation %</th> <th>Netta</th> <th>Fixed Income Style Box™</th> <th>Fondo</th> <th>Americhe</th> <th>Europa</th> <th>Asia</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>• Azioni</td> <td>0,00</td> <td></td> <td>-</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>• Obbligazioni</td> <td>450,43</td> <td></td> <td>-</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>• Liquidità</td> <td>-352,5</td> <td></td> <td>Duration Effettiva</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>• Altro</td> <td>0</td> <td></td> <td>Maturity effettiva</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td>2,07</td> <td>Qualità Credito</td> <td>Qualità Credito Media</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>Alto</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>Med</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>Basso</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>Sensibilità ai Tassi</td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>				Asset Allocation %	Netta	Fixed Income Style Box™	Fondo	Americhe	Europa	Asia	• Azioni	0,00		-				• Obbligazioni	450,43		-				• Liquidità	-352,5		Duration Effettiva				• Altro	0		Maturity effettiva					2,07	Qualità Credito	Qualità Credito Media						Alto							Med							Basso								Sensibilità ai Tassi																																																				
Asset Allocation %	Netta	Fixed Income Style Box™	Fondo	Americhe	Europa	Asia																																																																																																																				
• Azioni	0,00		-																																																																																																																							
• Obbligazioni	450,43		-																																																																																																																							
• Liquidità	-352,5		Duration Effettiva																																																																																																																							
• Altro	0		Maturity effettiva																																																																																																																							
	2,07	Qualità Credito	Qualità Credito Media																																																																																																																							
		Alto																																																																																																																								
		Med																																																																																																																								
		Basso																																																																																																																								
			Sensibilità ai Tassi																																																																																																																							
<p><b>Titoli principali</b></p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>Nome</th> <th>Settore</th> <th>%</th> <th>Fixed Income Sector Weightings %</th> <th>Fondo</th> <th>Ripartizione Geografica %</th> <th>Fondo</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2 Year Treasury Note Future...</td> <td>-</td> <td>24,87</td> <td>Governativo</td> <td>493,22</td> <td><b>America</b></td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>10 Year Japanese Government...</td> <td>-</td> <td>13,51</td> <td>Societario</td> <td>0,00</td> <td>Stati Uniti</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Japan (Government Of) 2,2%</td> <td>-</td> <td>10,13</td> <td>Cartolarizzazioni</td> <td>0,00</td> <td>Canada</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Colombia (Republic Of) 13,25%</td> <td>-</td> <td>6,13</td> <td>Enti Locali</td> <td>0,00</td> <td>America Latina e Centrale</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>United Kingdom of Great...</td> <td>-</td> <td>4,96</td> <td>Liquidità ed equivalenti</td> <td>-455,44</td> <td><b>Europa</b></td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>United Kingdom of Great...</td> <td>-</td> <td>4,92</td> <td>Derivati</td> <td>62,22</td> <td>Regno Unito</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Romania (Republic Of) 3,375%</td> <td>-</td> <td>4,92</td> <td></td> <td></td> <td>Europa Occidentale - Euro</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Australia (Commonwealth of)...</td> <td>-</td> <td>4,80</td> <td></td> <td></td> <td>Europa Occidentale - Non Euro</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Mexico (United Mexican...)...</td> <td>-</td> <td>4,48</td> <td></td> <td></td> <td>Europa dell'Est</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Romania (Republic Of) 2,75%</td> <td>-</td> <td>3,87</td> <td></td> <td></td> <td>Africa</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>% Primi 10 Titoli sul Patrimonio</td> <td>82,58</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>Medio Oriente</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Numeri Complessivo di Titoli Azionari</td> <td>0</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td><b>Asia</b></td> <td>0,00</td> </tr> <tr> <td>Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari</td> <td>61</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>Giappone</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>Australasia</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>Asia - Paesi Sviluppati</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td>Asia - Emergenti</td> <td>-</td> </tr> </tbody> </table>				Nome	Settore	%	Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Ripartizione Geografica %	Fondo	2 Year Treasury Note Future...	-	24,87	Governativo	493,22	<b>America</b>	0,00	10 Year Japanese Government...	-	13,51	Societario	0,00	Stati Uniti	-	Japan (Government Of) 2,2%	-	10,13	Cartolarizzazioni	0,00	Canada	-	Colombia (Republic Of) 13,25%	-	6,13	Enti Locali	0,00	America Latina e Centrale	-	United Kingdom of Great...	-	4,96	Liquidità ed equivalenti	-455,44	<b>Europa</b>	0,00	United Kingdom of Great...	-	4,92	Derivati	62,22	Regno Unito	-	Romania (Republic Of) 3,375%	-	4,92			Europa Occidentale - Euro	-	Australia (Commonwealth of)...	-	4,80			Europa Occidentale - Non Euro	-	Mexico (United Mexican...)...	-	4,48			Europa dell'Est	-	Romania (Republic Of) 2,75%	-	3,87			Africa	-	% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	82,58				Medio Oriente	-	Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0				<b>Asia</b>	0,00	Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	61				Giappone	-						Australasia	-						Asia - Paesi Sviluppati	-						Asia - Emergenti	-
Nome	Settore	%	Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Ripartizione Geografica %	Fondo																																																																																																																				
2 Year Treasury Note Future...	-	24,87	Governativo	493,22	<b>America</b>	0,00																																																																																																																				
10 Year Japanese Government...	-	13,51	Societario	0,00	Stati Uniti	-																																																																																																																				
Japan (Government Of) 2,2%	-	10,13	Cartolarizzazioni	0,00	Canada	-																																																																																																																				
Colombia (Republic Of) 13,25%	-	6,13	Enti Locali	0,00	America Latina e Centrale	-																																																																																																																				
United Kingdom of Great...	-	4,96	Liquidità ed equivalenti	-455,44	<b>Europa</b>	0,00																																																																																																																				
United Kingdom of Great...	-	4,92	Derivati	62,22	Regno Unito	-																																																																																																																				
Romania (Republic Of) 3,375%	-	4,92			Europa Occidentale - Euro	-																																																																																																																				
Australia (Commonwealth of)...	-	4,80			Europa Occidentale - Non Euro	-																																																																																																																				
Mexico (United Mexican...)...	-	4,48			Europa dell'Est	-																																																																																																																				
Romania (Republic Of) 2,75%	-	3,87			Africa	-																																																																																																																				
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	82,58				Medio Oriente	-																																																																																																																				
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	0				<b>Asia</b>	0,00																																																																																																																				
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	61				Giappone	-																																																																																																																				
					Australasia	-																																																																																																																				
					Asia - Paesi Sviluppati	-																																																																																																																				
					Asia - Emergenti	-																																																																																																																				
<p><b>Anagrafica</b></p> <table border="1"> <tbody> <tr> <td>Società di Gestione</td> <td>BlueBay Funds Management Company S.A.</td> <td>Patrimonio Classe (Mln)</td> <td>-</td> <td>Investimento Min. Ingresso</td> <td>10.000 EUR</td> </tr> <tr> <td>Telefono</td> <td>-</td> <td>Domicilio</td> <td>LUSSEMBURGO</td> <td>Investimento Min. Successivo</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Web</td> <td>www.bluebayinvest.com</td> <td>Valuta del Fondo</td> <td>USD</td> <td>T.E.R.</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>Data di Partenza</td> <td>19/09/2016</td> <td>UCITS</td> <td>Si</td> <td>Spese correnti</td> <td>1,05%</td> </tr> <tr> <td>Nome del Gestore</td> <td>Mark Dowding Russel Matthews</td> <td>Inc/Acc</td> <td>Acc</td> <td>Commissione di incentivo</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td></td> <td>Kaspar Hense</td> <td>ISIN</td> <td>LU1480175907</td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>Data Inizio Gestione</td> <td>22/12/2015</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> <tr> <td>NAV (03/08/2021)</td> <td>USD 112,00</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> </tr> </tbody> </table>				Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	-	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR	Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-	Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-	Data di Partenza	19/09/2016	UCITS	Si	Spese correnti	1,05%	Nome del Gestore	Mark Dowding Russel Matthews	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-		Kaspar Hense	ISIN	LU1480175907			Data Inizio Gestione	22/12/2015					NAV (03/08/2021)	USD 112,00																																																																											
Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	-	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR																																																																																																																					
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-																																																																																																																					
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	-																																																																																																																					
Data di Partenza	19/09/2016	UCITS	Si	Spese correnti	1,05%																																																																																																																					
Nome del Gestore	Mark Dowding Russel Matthews	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-																																																																																																																					
	Kaspar Hense	ISIN	LU1480175907																																																																																																																							
Data Inizio Gestione	22/12/2015																																																																																																																									
NAV (03/08/2021)	USD 112,00																																																																																																																									

## BlueBay Funds - BlueBay Global Sovereign Opportunities Fund C - USD

Patrimonio Netto (Mln)

473,04 USD

(31/12/2025)