

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund G USD Cap

Categoria Morningstar™

Obbligazionari Altro

Benchmark Morningstar

Not Categorized

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR USD

Morningstar Rating™

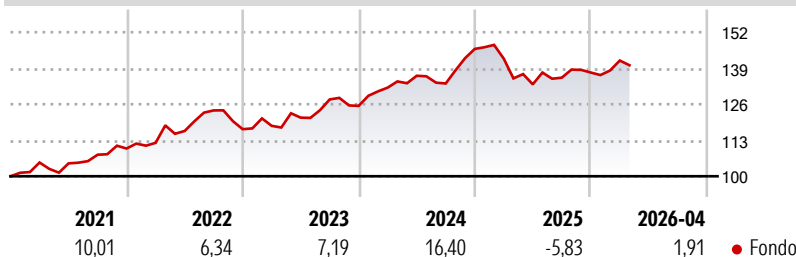
Senza rating

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the ICE BofA Merrill Lynch Euro Currency 3-Month Deposit Offered Rate Constant Maturity Index, by investing in a portfolio of Structured Credit Securities. There are no restrictions on the extent to which the Sub-Fund's portfolio and performance may deviate from the ones of the benchmark. As part of the investment process, the Investment Manager has full discretion over the composition of the Sub-Fund's portfolio and may take exposure to companies, countries or sectors not included in the benchmark.

Misure di Rischio

| | | | |
|-------------------|---|-----------------|------|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,44 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 7,28 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

Rendimenti

Portafoglio 31/03/2026


| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni | 0,00 |
| ● Obbligazioni | 93,76 |
| ● Liquidità | 6,24 |
| ● Altro | 0,00 |

Fixed Income Style
Box™

| Quantità Credito | | Fondo |
|------------------|-------|-----------------------|
| Alto | Basso | |
| | | Duration Effettiva |
| | | Maturità effettiva |
| | | Qualità Credito Media |
| | | Sensibilità ai Tassi |

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media
Fondo
Credit Quality %
Fond
Credit Quality %
Fond
Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Satus 2024-1 PLC 5.78236% | — | 1,84 |
| MA Money Residential... | — | 1,48 |
| Domi 2026-1 BV 2.62534% | — | 1,28 |
| Sunrise SPV 98 S.r.l. 2.723% | — | 1,20 |
| Avanti AU Auto ABS Trust... | — | 1,19 |
| Fairbridge 2025-1 BV 2.974% | — | 1,13 |
| Latitude Aust Personal Loans... | — | 1,08 |
| Fulvia SPV S.r.l. 2.811% | — | 1,08 |
| Homes 2025-NQM4 Trust 5.22% | — | 0,97 |
| London Cards No 2 PLC 7.1791% | — | 0,94 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 12,19 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 232 |

Fixed Income Sector Weightings %

| | Fondo |
|----------------------------|--------------|
| 🏠 Governativo | 0,00 |
| 🏢 Societario | 0,00 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 93,76 |
| 🏠 Enti Locali | 0,00 |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | 32,42 |
| 🏠 Derivati | -26,17 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 0,38 |
| Da 0 a 4 cedole | 30,88 |
| Da 4 a 6 cedole | 62,21 |
| Da 6 a 8 cedole | 6,54 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,00 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 0,26 |
| da 3 a 5 | 2,78 |
| da 5 a 7 | 11,54 |
| da 7 a 10 | 18,46 |
| da 10 a 15 | 34,33 |
| da 15 a 20 | 4,74 |
| da 20 a 30 | 4,42 |
| oltre 30 | 23,47 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,08 USD | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | - | (08/05/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,29% |
| Data di Partenza | 17/12/2018 | Valuta del Fondo | USD | Spese correnti | 0,29% |
| Nome del Gestore | Sid Chhabra | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| | Tom Mowl | Inc/Acc | Acc | | |
| Data Inizio Gestione | 20/04/2021 | ISIN | LU1920264584 | | |
| NAV (08/05/2026) | USD 150,26 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 745,03 EUR | | | | |

(31/03/2026)