

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund G USD (QIDiv)

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	0,06
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,77
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

Termine	Fondo
3-Mesi	2,57
6-Mesi	3,17
1-Anno	-0,39
3-Anni Ann.ti	3,38
5-Anni Ann.ti	6,13
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 21/10/2025

Rendimenti

Trimestrale %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	-2,40	-6,52	1,80	-
2024	5,27	3,24	-2,04	9,33
2023	1,06	2,49	5,41	-1,79
2022	1,86	3,85	6,42	-5,48

Portafoglio 31/03/2026



Asset Allocation %

Asset Class	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	93,76
Liquidità	6,24
Altro	0,00

Fixed Income Style

Box™

Quantità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

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 %

Settore	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	93,76
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	32,42
Derivati	-26,17

Coupon Range %

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 %

Scadenza	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)	-	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,29%
Data di Partenza	05/04/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,29%
Nome del Gestore	Sid Chhabra	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
	Tom Mowl	ISIN	LU1959294593		
Data Inizio Gestione	20/04/2021				
NAV (21/10/2025)	USD 113,08				
Patrimonio Netto (Mln)	745,03 EUR				

(31/03/2026)