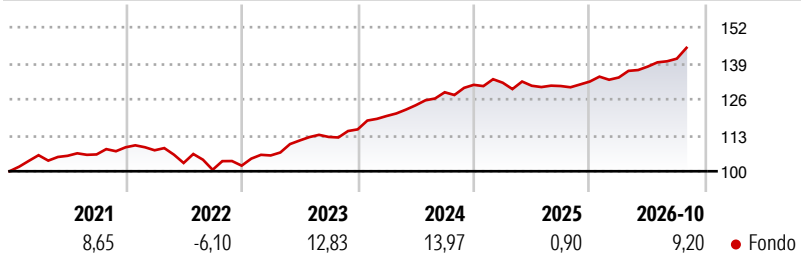
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund G GBP (QIDiv)

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Obbligazionari Altro	Not Categorized Usato nel Report	ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR USD	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.

Rendimenti



2021	2022	2023	2024	2025	2026-10	
8,65	-6,10	12,83	13,97	0,90	9,20	● Fondo

Misure di Rischio

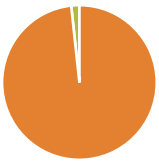
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	1,59
3Y Beta	-	3Y Std Dev	3,75
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	3,86
6-Mesi	6,13
1-Anno	11,07
3-Anni Ann.ti	8,57
5-Anni Ann.ti	6,29
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 06/11/2026

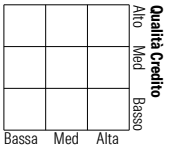
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	1,11	2,95	2,07	-
2025	0,58	-0,83	-0,08	1,24
2024	4,20	3,23	3,79	2,08
2023	3,61	5,11	1,15	2,42
2022	-0,99	-4,26	-2,39	1,49

Portafoglio 30/09/2026



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	98,30
Liquidità	1,70
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™



	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
Satus 2024-1 PLC 5.78571%	—	1,62
WISR Momentum Trust 2026-1...	—	1,47
Ciret 26 A Regs	—	1,45
Cashmere Funding Trust...	—	1,34
Ares Lusitani Stc S.A. 4.046%	—	1,17
Uk Logistics 2026-2 DAC 5.104%	—	1,15
Golden Ray SA Compartment 3...	—	1,10
Taurus 2025-1 Eu Designated...	—	1,09
Capital Four Clo I...	—	1,06
Contego Clo X Designated...	—	1,04
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		12,49
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		262

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	2,70
Cartolarizzazioni	95,59
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	71,33
Derivati	-69,63

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	5,23
Da 0 a 4 cedole	17,92
Da 4 a 6 cedole	63,41
Da 6 a 8 cedole	12,82
Da 8 a 10 cedole	0,61
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	0,12
da 3 a 5	5,24
da 5 a 7	5,16
da 7 a 10	18,75
da 10 a 15	33,64
da 15 a 20	6,38
da 20 a 30	1,79
oltre 30	28,93

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.
Telefono	-
Web	www.bluebayinvest.com
Data di Partenza	05/04/2019
Nome del Gestore	Sid Chhabra Tom Mowl
Data Inizio Gestione	20/04/2021
NAV (06/11/2026)	GBP 108,70
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2026)	517,55 EUR

Patrimonio Classe (Mln) (06/11/2026)	0,14 GBP
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	GBP
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
ISIN	LU1959294759

Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,29%
Spese correnti	0,29%
Commissione di incentivo	-

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR