

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

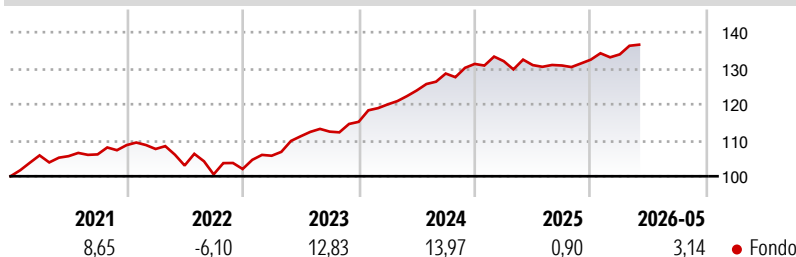
Senza rating

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 | 1,24 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 3,66 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

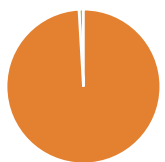
Rendimenti

Rend. Cumulati %

| Periodo | Fondo |
|----------------|-------|
| 3-Mesi | 1,94 |
| 6-Mesi | 3,99 |
| 1-Anno | 4,89 |
| 3-Anni Ann.ti | 7,44 |
| 5-Anni Ann.ti | 5,48 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

Rendimenti

| Periodo | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---------|-------|-------|-------|------|
| 2026 | 1,11 | - | - | - |
| 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 31/05/2026


| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|--------|
| ● Azioni | 0,00 |
| ● Obbligazioni | 100,93 |
| ● Liquidità | -0,93 |
| ● Altro | 0,00 |

Fixed Income Style Box™

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

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo
Credit Quality %

| Fond | Credit Quality % | Fond | Credit Quality % |
|------|------------------|------|------------------|
| o | o | o | o |

Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| WISR Momentum Trust 2026-1... | — | 2,09 |
| Polaris 2026-2 PLC 0% | — | 1,87 |
| Satus 2024-1 PLC 5.78271% | — | 1,78 |
| Fairbridge 2025-1 BV 3.145% | — | 1,67 |
| Satus 2026-1 PLC 4.78271% | — | 1,56 |
| Domi 2026-1 BV 2.892% | — | 1,20 |
| Avanti AU Auto ABS Trust... | — | 1,11 |
| Together Asset Backed... | — | 1,05 |
| Together Asset Backed... | — | 1,05 |
| Hawksmoor Mortgage Funding... | — | 1,03 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 14,41 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 0 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 237 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Settore | Fondo |
|----------------------------|--------------|
| 🏠 Governativo | 0,00 |
| 🏢 Societario | 0,00 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 100,93 |
| 🏠 Enti Locali | 0,00 |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | 28,65 |
| 🏠 Derivati | -29,58 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 2,20 |
| Da 0 a 4 cedole | 27,81 |
| Da 4 a 6 cedole | 64,57 |
| Da 6 a 8 cedole | 5,42 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,00 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

Scadenze %

| Periodo | Fondo |
|------------|-------|
| da 1 a 3 | 0,00 |
| da 3 a 5 | 4,74 |
| da 5 a 7 | 10,35 |
| da 7 a 10 | 19,66 |
| da 10 a 15 | 29,82 |
| da 15 a 20 | 4,23 |
| da 20 a 30 | 3,45 |
| oltre 30 | 27,76 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,14 GBP | Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bluebayinvest.com | Valuta del Fondo | GBP | T.E.R. | 0,29% |
| Data di Partenza | 05/04/2019 | UCITS | Si | Spese correnti | 0,29% |
| Nome del Gestore | Sid Chhabra Tom Mowl | Inc/Acc | Inc | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 20/04/2021 | ISIN | LU1959294759 | | |
| NAV (25/06/2026) | GBP 109,42 | | | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 773,55 EUR | | | | |

(31/05/2026)

[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 produttrici; (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.