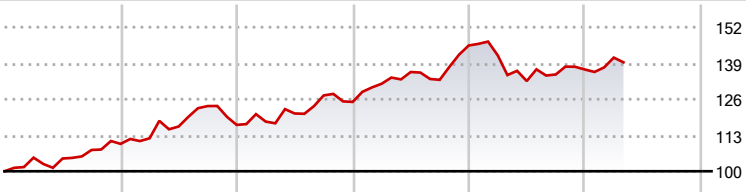
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund Q USD Cap

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	2026-04	
9,88	6,24	7,11	16,29	-5,95	1,88	● Fondo

Misure di Rischio

3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,43
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,27
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	1,43
6-Mesi	0,91
1-Anno	2,87
3-Anni Ann.ti	5,62
5-Anni Ann.ti	6,40
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 07/05/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	3,12	-	-	-
2025	-2,45	-6,54	1,78	1,35
2024	5,25	3,22	-2,07	9,31
2023	1,02	2,48	5,39	-1,84
2022	1,84	3,79	6,36	-5,50

Portafoglio 31/03/2026

Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	93,76
● Liquidità	6,24
● 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 5.78236%	—	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.
Telefono	-
Web	www.bluebayinvest.com
Data di Partenza	06/07/2020
Nome del Gestore	Sid Chhabra Tom Mowl
Data Inizio Gestione	20/04/2021
NAV (07/05/2026)	USD 137,83
Patrimonio Netto (Mln) (31/03/2026)	745,03 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (07/05/2026)	59,32 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1960062906
Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,39%
Spese correnti	0,39%
Commissione di incentivo	-

© 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.