

# BlueBay Funds - BlueBay High Grade Short Duration Asset-Backed Credit Fund G EUR

**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™**

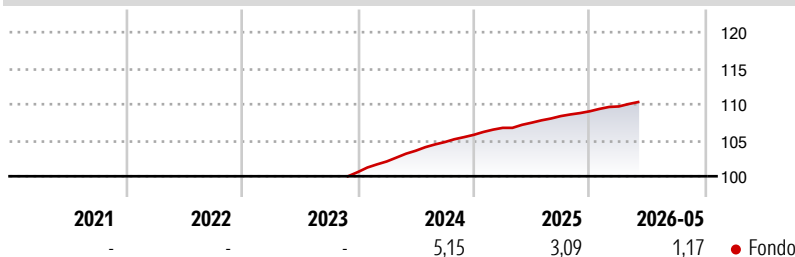
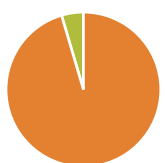
Senza rating

**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	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

**Rendimenti**

**Portafoglio 31/05/2026**


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	105,03
● Liquidità	-5,03
● Altro	0,00

**Fixed Income Style Box™**

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

Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,79	2026	0,61	-	-	-
6-Mesi	1,41	2025	0,92	0,67	0,85	0,62
1-Anno	2,90	2024	1,47	1,46	1,16	0,96
3-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-					

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
St. Paul's CLO VIII DAC 3.44%	-	3,08
Domi 2021-1 BV 3.15%	-	2,86
Santander Residential 1 FT...	-	2,57
Stratton BTL Mortgage...	-	2,46
Jubilee Place 5 B.V. 3.64%	-	2,33
WISR Momentum Trust 2026-1...	-	2,15
Finance Ireland Rmbs No. 7...	-	2,13
Madison Park Euro Funding...	-	1,97
Hill FL 2024-1 BV 2.718%	-	1,94
Status 2026-1 PLC 4.63349%	-	1,93
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		23,42
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		84

**Fixed Income Sector Weightings %**

	Fondo
🏠 Governativo	0,00
⚙️ Societario	0,00
🏠 Cartolarizzazioni	105,03
🏠 Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	7,63
🏠 Derivati	-12,67
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>
0 coupon	2,85
Da 0 a 4 cedole	59,51
Da 4 a 6 cedole	36,72
Da 6 a 8 cedole	0,93
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	1,26
da 3 a 5	9,52
da 5 a 7	15,33
da 7 a 10	25,70
da 10 a 15	7,84
da 15 a 20	9,75
da 20 a 30	8,28
oltre 30	22,33

**Anagrafica**

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	36,02 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	(24/06/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,29%
Data di Partenza	29/11/2023	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,29%
Nome del Gestore	Ashley Blatter Sid Chhabra Tom Mowl Scott Spurling	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	20/11/2020	Inc/Acc	Acc		
NAV (25/06/2026)	EUR 110,52	ISIN	LU2249766747		
Patrimonio Netto (Mln)	203,79 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 prodotte; (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.