

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

**Categoria Morningstar™**

Obbligazionari Altro

**Benchmark Morningstar**
Not Categorized  
Usato nel Report
**Benchmark Dichiarato**

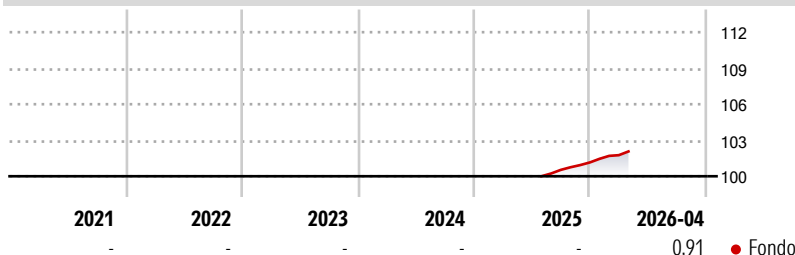
ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR USD

**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.

**Rendimenti**

**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	-

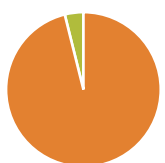
**Rend. Cumulati %**

Periodo	Fondo
3-Mesi	0,59
6-Mesi	1,32
1-Anno	-
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 07/05/2026

**Rendimenti**

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,60	-	-	-
2025	-	-	-	0,62
2024	-	-	-	-
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

**Portafoglio 31/03/2026**

**Asset Allocation %**

Categoria	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	96,11
Liquidità	3,89
Altro	0,00

**Fixed Income Style**
**Box™**

Quantità Credito		Fondo
Alto	Basso	
Alto	Alto	0
Alto	Medio	0
Alto	Basso	0
Medio	Alto	0
Medio	Medio	0
Medio	Basso	0
Basso	Alto	0
Basso	Medio	0
Basso	Basso	0

Sensibilità ai Tassi

**Duration Effettiva**

-

**Maturità effettiva**

-

**Qualità Credito Media**

-

**Credit Quality %**

Fond

0

**Credit Quality %**

Fond

0

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
St. Paul's CLO VIII DAC 3.226%	-	3,22
Domi 2021-1 BV 3.15%	-	2,97
Santander Residential 1 FT...	-	2,85
Signal Harmonic CLO II...	-	2,57
Jubilee Place 5 B.V. 3.426%	-	2,43
Finance Ireland Auto...	-	2,29
MA Money Residential...	-	2,23
Finance Ireland Rmbs No. 7...	-	2,21
Hill FL 2024-1 BV 2.688%	-	2,12
Madison Park Euro Funding...	-	2,05
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		24,92
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		73

**Fixed Income Sector Weightings %**

Settore	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	96,11
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	-3,73
Derivati	7,62
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	69,22
Da 4 a 6 cedole	29,10
Da 6 a 8 cedole	1,68
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	0,00
da 3 a 5	6,26
da 5 a 7	16,43
da 7 a 10	28,32
da 10 a 15	8,82
da 15 a 20	10,05
da 20 a 30	6,03
oltre 30	24,09

**Anagrafica**

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	5,08 EUR	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	0,34%
Data di Partenza	09/07/2025	UCITS	Si	Spese correnti	0,34%
Nome del Gestore	Ashley Blatter Sid Chhabra Tom Mowl Scott Spurling	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	20/11/2020	ISIN	LU2249767125		
NAV (07/05/2026)	EUR 102,32				
Patrimonio Netto (Mln)	195,64 EUR				

(31/03/2026)