BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund S USD

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	2026-05	
-	-	-	16,33	-5,89	2,94	● Fondo

Misure di Rischio

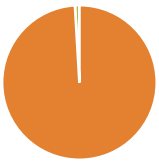
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	0,30
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,91
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	3,22
6-Mesi	6,38
1-Anno	8,36
3-Anni Ann.ti	6,29
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 25/06/2026

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	3,14	-	-	-
2025	-2,43	-6,53	1,80	1,36
2024	5,25	3,23	-2,06	9,32
2023	-	-	5,40	-1,83
2022	-	-	-	-

Portafoglio 31/05/2026



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	100,93
Liquidità	-0,93
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	%
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 %	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 %	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.
Telefono	-
Web	www.bluebayinvest.com
Data di Partenza	25/04/2023
Nome del Gestore	Sid Chhabra Tom Mowl
Data Inizio Gestione	20/04/2021
NAV (25/06/2026)	USD 127,60
Patrimonio Netto (Mln) (31/05/2026)	773,55 EUR

Patrimonio Classe (Mln) (25/06/2026)	54,07 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1960063110

Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,34%
Spese correnti	0,34%
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.