

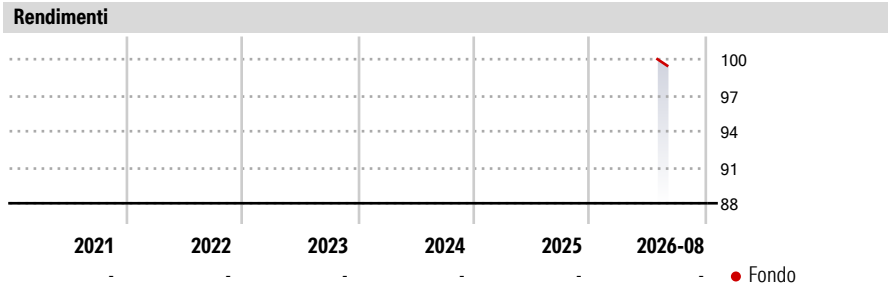
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund R USD (MIDiv)

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.

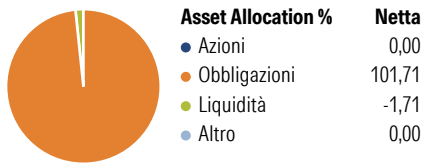
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-



Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-	Trimestrali %				
6-Mesi	-	2026	-	-	-	-
1-Anno	-	2025	-	-	-	-
3-Anni Ann.ti	-	2024	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 24/09/2026

Portafoglio 31/08/2026



Fixed Income Style	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Box™			o		o
Duration Effettiva	-				
Maturità effettiva	-				
Qualità Credito Media					
Qualità Credito					
Sensibilità ai Tassi					

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Satus 2024-1 PLC 5.78455%	—	1,67
WISR Momentum Trust 2026-1...	—	1,61
Meridian Funding 2025-1 PLC...	—	1,52
Cashmere Funding Trust...	—	1,39
Ares Lusitani Stc S.A. 3.816%	—	1,19
Uk Logistics 2026-2 DAC...	—	1,17
Taurus 2025-1 Eu Designated...	—	1,12
Capital Four Clo I...	—	1,08
Aqueduct European Clo 5-2020...	—	1,00
Hawksmoor Mortgage Funding...	—	0,96
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		12,73
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		269

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	101,71
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	28,58
Derivati	-30,28
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	1,54
Da 0 a 4 cedole	21,16
Da 4 a 6 cedole	67,13
Da 6 a 8 cedole	9,56
Da 8 a 10 cedole	0,61
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Scadenze %	Fondo
da 1 a 3	0,12
da 3 a 5	5,14
da 5 a 7	4,45
da 7 a 10	20,28
da 10 a 15	32,47
da 15 a 20	5,22
da 20 a 30	2,87
oltre 30	29,45

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	0,55 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	(23/09/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,14%
Data di Partenza	01/07/2026	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,14%
Nome del Gestore	Sid Chhabra	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
	Tom Mowl	Inc/Acc	Inc		
Data Inizio Gestione	20/04/2021	ISIN	LU2849599142		
NAV (24/09/2026)	USD 100,34				
Patrimonio Netto (Mln)	839,54 EUR				

(31/08/2026)

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.