

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

Categoria Morningstar™
Cap

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato
ICE BofA EUR Ccy 3M Dep OR CM TR USD

Morningstar Rating™
Senza rating

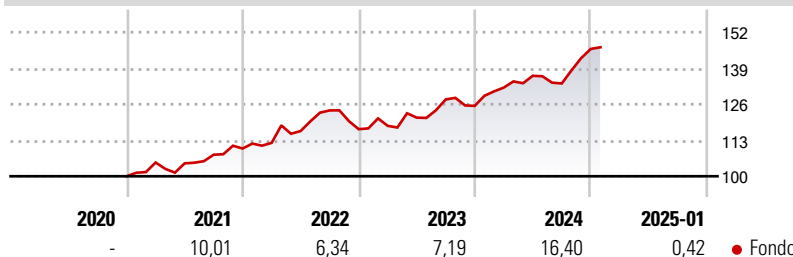
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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	0,96
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,30
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

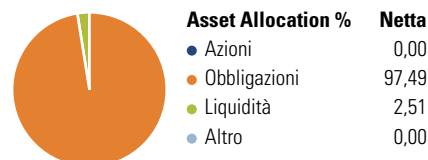
Rendimenti



Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	6,88	Trimestrali %				
6-Mesi	9,56	2025	-	-	-	-
1-Anno	13,87	2024	5,27	3,24	-2,04	9,34
3-Anni Ann.ti	10,42	2023	1,04	2,50	5,41	-1,82
5-Anni Ann.ti	6,64	2022	1,86	3,81	6,39	-5,47
10-Anni Ann.ti	-	2021	4,95	-0,29	2,98	2,07

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

Portafoglio 31/12/2024



Fixed Income Style Box™	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Duration Effettiva	-		0		0
Maturità effettiva	-				
Qualità Credito Media					

Titoli principali

Nome	Settore	%
Elstree Funding No 2 PLC...	-	2,84
Satus 2024-1 PLC 6.75568%	-	2,07
Signal Harmonic CLO II...	-	1,90
Elstree Funding No.5 PLC...	-	1,83
Mulcair Securities No.3...	-	1,59
UK Logistics 2024-1...	-	1,57
Dowson 2024-1 PLC 6.30471%	-	1,57
Signal Harmonic CLO II...	-	1,50
CVC Cordatus Loan Fund...	-	1,36
Blackrock European CLO IV...	-	1,32
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		17,54
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		149

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Scadenze %	Fondo
Governativo	0,00	da 1 a 3	0,00
Societario	1,06	da 3 a 5	1,31
Cartolarizzazioni	96,43	da 5 a 7	20,32
Enti Locali	0,00	da 7 a 10	19,36
Liquidità ed equivalenti	34,35	da 10 a 15	26,69
Derivati	-31,84	da 15 a 20	4,77
		da 20 a 30	5,52
		oltre 30	22,02
Coupon Range %	Fondo		
0 coupon	1,88		
Da 0 a 4 cedole	6,56		
Da 4 a 6 cedole	56,71		
Da 6 a 8 cedole	30,95		
Da 8 a 10 cedole	3,90		
Da 10 a 12 cedole	0,00		
Oltre 12 cedole	0,00		

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	-	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
		Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
		Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,29%
Telefono	-	UCITS	Si	Spese correnti	0,29%
Web	www.bluebayinvest.com	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data di Partenza	17/12/2018	ISIN	LU1920264584		
Nome del Gestore	Sid Chhabra Tom Mowl				
Data Inizio Gestione	20/04/2021				
NAV (03/02/2025)	USD 139,25				
Patrimonio Netto (Mln)	375,00 EUR				

(31/12/2024)