

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

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	0,31
3Y Beta	-	3Y Std Dev	6,91
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	100,93
● Liquidità	-0,93
● Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

Qualità Credito: Alto, Med, Basso
Sensibilità ai Tassi: Bassa, Med, Alta

Duration Effettiva	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Duration Effettiva	-		0		0
Maturità effettiva	-				
Qualità Credito Media	-				

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.	Patrimonio Classe (Mln)	0,08 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	(25/06/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,29%
Data di Partenza	17/12/2018	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,29%
Nome del Gestore	Sid Chhabra	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
	Tom Mowl	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	20/04/2021	ISIN	LU1920264584		
NAV (25/06/2026)	USD 151,38				
Patrimonio Netto (Mln)	773,55 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 produttrici; (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.