

# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund G GBP

**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™**

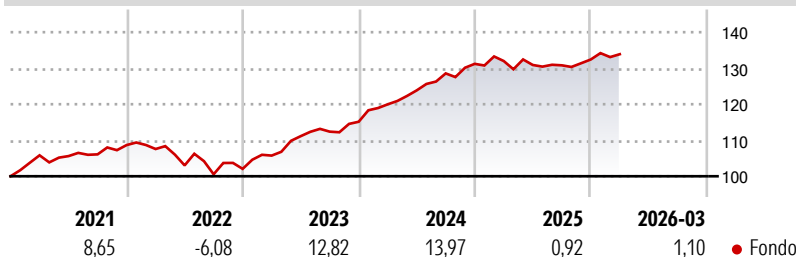
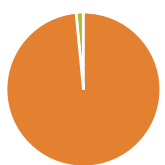
Senza rating

**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 | 1,34 |
| 3Y Beta           | - | 3Y Std Dev      | 3,82 |
| 3Y R-Squared      | - | 3Y Risk         | -    |
| 3Y Info Ratio     | - | 5Y Risk         | -    |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk        | -    |

**Rendimenti**

**Portafoglio 31/01/2026**


| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| ● Azioni           | 0,00  |
| ● Obbligazioni     | 98,47 |
| ● Liquidità        | 1,53  |
| ● Altro            | 0,00  |

**Fixed Income Style**
**Box™**

|  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |
|  |  |  |  |  |

Quantità Credito  
Alto  
Med  
Basso

Sensibilità ai Tassi  
Bassa  
Med  
Alta

Duration Effettiva

Maturità effettiva

Qualità Credito Media

Fondo

Credit Quality %

Fond

Credit Quality %

Fond

**Titoli principali**

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| Satus 2024-1 PLC 5.77976%                   | —       | 1,90  |
| Avanti AU Auto ABS Trust...                 | —       | 1,58  |
| DOWSON 2025-1 PLC 4.8296%                   | —       | 1,56  |
| Fairbridge 2025-1 BV 2.97272%               | —       | 1,29  |
| Golden Bar (Securitisation)...              | —       | 1,28  |
| Latitude Aust Personal Loans...             | —       | 1,24  |
| Fortuna Consumer Loan ABS...                | —       | 1,11  |
| HOMES 2025-NQM4 TRUST 5.22%                 | —       | 1,03  |
| Asimi Funding 2025-2 PLC...                 | —       | 0,99  |
| London Cards No 2 PLC 7.17856%              | —       | 0,98  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 12,96 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 0     |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 237   |

**Fixed Income Sector Weightings %**

|                            | Fondo        |
|----------------------------|--------------|
| 🏠 Governativo              | 0,00         |
| 🏢 Societario               | 0,41         |
| 🏠 Cartolarizzazioni        | 98,06        |
| 🏠 Enti Locali              | 0,00         |
| 🏠 Liquidità ed equivalenti | 26,85        |
| 🏠 Derivati                 | -25,32       |
| <b>Coupon Range %</b>      | <b>Fondo</b> |
| 0 coupon                   | 0,78         |
| Da 0 a 4 cedole            | 35,23        |
| Da 4 a 6 cedole            | 57,31        |
| Da 6 a 8 cedole            | 6,68         |
| 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   | 0,26  |
| da 3 a 5   | 2,74  |
| da 5 a 7   | 12,68 |
| da 7 a 10  | 19,39 |
| da 10 a 15 | 33,48 |
| da 15 a 20 | 7,46  |
| da 20 a 30 | 3,10  |
| oltre 30   | 20,88 |

**Anagrafica**

|                        |                                       |                         |              |                              |            |
|------------------------|---------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|------------|
| Società di Gestione    | BlueBay Funds Management Company S.A. | Patrimonio Classe (Mln) | 0,22 GBP     | Investimento Min. Ingresso   | 10.000 EUR |
| Telefono               | -                                     | Domicilio               | LUSSEMBURGO  | Investimento Min. Successivo | -          |
| Web                    | www.bluebayinvest.com                 | Valuta del Fondo        | GBP          | T.E.R.                       | 0,29%      |
| Data di Partenza       | 13/02/2019                            | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 0,29%      |
| Nome del Gestore       | Sid Chhabra                           | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -          |
|                        | Tom Mowl                              | ISIN                    | LU1920264667 |                              |            |
| Data Inizio Gestione   | 20/04/2021                            |                         |              |                              |            |
| NAV (13/04/2026)       | GBP 140,24                            |                         |              |                              |            |
| Patrimonio Netto (Mln) | 724,40 EUR                            |                         |              |                              |            |

(31/01/2026)