

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

Categoria Morningstar™
(OIDiv) Altro

Benchmark Morningstar
Not Categorized
Usato nel Report

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

Morningstar Rating™
Senza rating

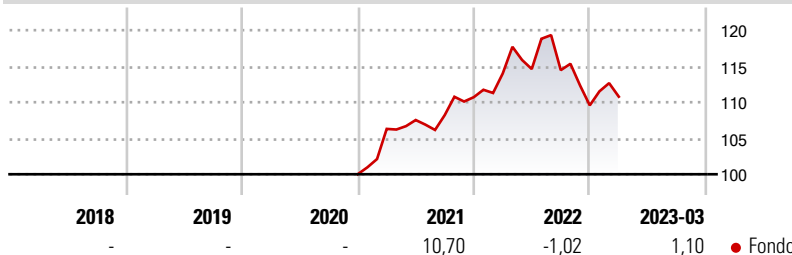
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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	1,06
3Y Beta	-	3Y Std Dev	8,64
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rendimenti



Rend. Cumulati %

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,07
6-Mesi	-3,04
1-Anno	-4,53
3-Anni Ann.ti	5,87
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 19/04/2023

Rendimenti

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
Trimestrali %				
2025	-	-	-	-
2024	-	-	-	-
2023	1,10	-	-	-
2022	2,98	0,53	-0,13	-4,27
2021	6,29	1,16	0,64	2,30

Portafoglio 31/12/2024



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	97,49
● Liquidità	2,51
● Altro	0,00

Fixed Income

Style Box™

Qualità Credito		Sensibilità ai Tassi	
Alto	Basso	Bassa	Alta

Duration Effettiva
Maturità effettiva
Qualità Credito Media

Fondo

Credit Quality %

Fond Credit Quality % Fond

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 %

Settore	Fondo
🏛️ Governativo	0,00
⚙️ Societario	1,06
🏠 Cartolarizzazioni	96,43
👤 Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	34,35
📄 Derivati	-31,84
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

Scadenze %

Periodo	Fondo
da 1 a 3	0,00
da 3 a 5	1,31
da 5 a 7	20,32
da 7 a 10	19,36
da 10 a 15	26,69
da 15 a 20	4,77
da 20 a 30	5,52
oltre 30	22,02

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	CAD	T.E.R.	-
Telefono	-	UCITS	Si	Spese correnti	0,29%
Web	www.bluebayinvest.com	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
Data di Partenza	05/04/2019	ISIN	LU1959294833		
Nome del Gestore	Sid Chhabra Tom Mowl				
Data Inizio Gestione	20/04/2021				
NAV (19/04/2023)	CAD 103,46				
Patrimonio Netto (Mln)	375,00 EUR				

(31/12/2024)