

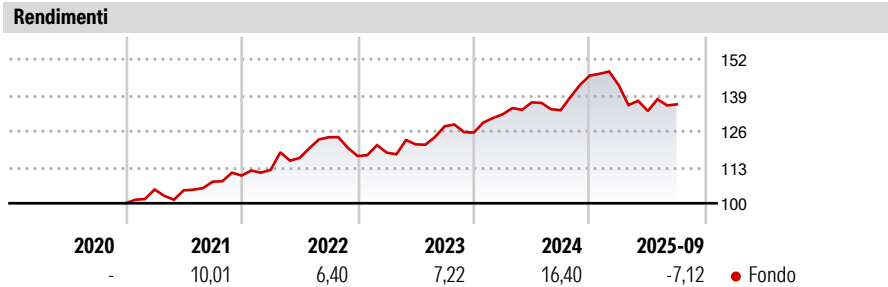
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund G USD (QIDiv)

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	0,06
3Y Beta	-	3Y Std Dev	7,77
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	2,57	Trimestrali %				
6-Mesi	3,17	2026	-	-	-	-
1-Anno	-0,39	2025	-2,40	-6,52	1,80	-
3-Anni Ann.ti	3,38	2024	5,27	3,24	-2,04	9,33
5-Anni Ann.ti	6,13	2023	1,06	2,49	5,41	-1,79
10-Anni Ann.ti	-	2022	1,86	3,85	6,42	-5,48

Rendimenti aggiornati al 21/10/2025

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style	Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
Box™					
Duration Effettiva	-		0		0
Maturità effettiva	-				
Qualità Credito Media					
Qualità Credito					
Alto					
Med					
Basso					
Sensibilità ai Tassi					
Bassa					
Med					
Alta					

Titoli principali		
Nome	Settore	%
Satus 2024-1 PLC 5.91497%	—	1,98
Avanti AU Auto ABS Trust...	—	1,77
DOWSON 2025-1 PLC 4.93669%	—	1,62
Fairbridge 2025-1 BV 2.97272%	—	1,35
Latitude Aust Personal Loans...	—	1,34
Golden Bar (Securitisation)...	—	1,33
HOMES 2025-NQM4 TRUST 5.22%	—	1,12
London Cards No 2 PLC 7.17617%	—	1,02
Providus Clo IV Designated...	—	0,97
Odyssey Funding PLC 5.18669%	—	0,96
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		13,48
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		216

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	93,08
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	42,75
Derivati	-35,83
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,40
Da 0 a 4 cedole	35,92
Da 4 a 6 cedole	55,50
Da 6 a 8 cedole	8,18
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	0,29
da 3 a 5	0,55
da 5 a 7	12,69
da 7 a 10	18,88
da 10 a 15	35,52
da 15 a 20	8,53
da 20 a 30	2,08
oltre 30	21,46

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	-	Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Valuta del Fondo	USD	T.E.R.	0,29%
Data di Partenza	05/04/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,29%
Nome del Gestore	Sid Chhabra	Inc/Acc	Inc	Commissione di incentivo	-
	Tom Mowl	ISIN	LU1959294593		
Data Inizio Gestione	20/04/2021				
NAV (21/10/2025)	USD 113,08				
Patrimonio Netto (Mln)	689,46 EUR				

(31/12/2025)