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

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Altro | Not Categorized<br>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.

## Rendimenti

## Misure di Rischio

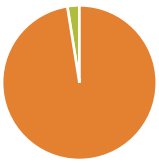
| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | - | 3Y Sharpe Ratio | 0,70 |
| 3Y Beta | - | 3Y Std Dev | 5,62 |
| 3Y R-Squared | - | 3Y Risk | - |
| 3Y Info Ratio | - | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | - | 10Y Risk | - |

| Rend. Cumulati % | Fondo |
|---|---|
| 3-Mesi | 2,37 |
| 6-Mesi | 6,06 |
| 1-Anno | 11,34 |
| 3-Anni Ann.ti | 6,52 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,99 |
| 10-Anni Ann.ti | - |

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2025 | - | - | - | - |
| 2024 | 4,20 | 3,23 | 3,79 | 2,08 |
| 2023 | 3,61 | 5,11 | 1,15 | 2,42 |
| 2022 | -0,99 | -4,26 | -2,39 | 1,49 |
| 2021 | 5,80 | -0,20 | 0,46 | 2,43 |

## Portafoglio 31/12/2024



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

**Fixed Income Style Box™**

| Fondo | |
|---|---|
| Duration Effettiva | - |
| Maturity effettiva | - |
| Qualità Credito Media | |

| Credit Quality % | Fondo | Credit Quality % | Fondo |
|---|---|---|---|

### 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 |
|---|---|
| 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 % | 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. |
| Telefono | - |
| Web | www.bluebayinvest.com |
| Data di Partenza | 05/04/2019 |
| Nome del Gestore | Sid Chhabra<br>Tom Mowl |
| Data Inizio Gestione | 20/04/2021 |
| NAV (03/02/2025) | GBP 106,86 |
| Patrimonio Netto (Mln) (31/12/2024) | 375,00 EUR |

| | |
|---|---|
| Patrimonio Classe (Mln) | - |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | GBP |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Inc |
| ISIN | LU1959294759 |

| | |
|---|---|
| Investimento Min. Ingresso | 10.000 EUR |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | 0,29% |
| Spese correnti | 0,29% |
| Commissione di incentivo | - |

© 2025 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 prodotto; (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.