

# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund Q EUR

**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™**

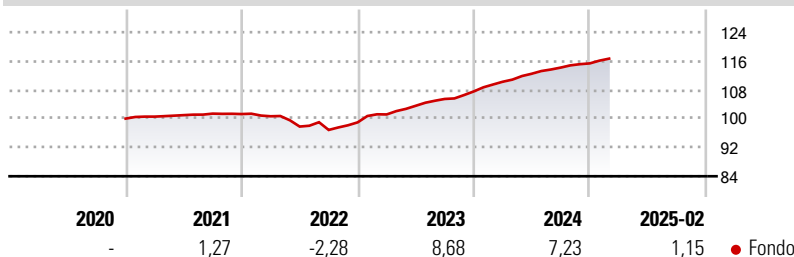
Senza rating

**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	1,06
3Y Beta	-	3Y Std Dev	2,58
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

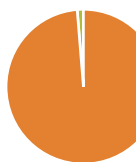
**Rendimenti**

**Rend. Cumulati %**

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,27
6-Mesi	2,43
1-Anno	6,38
3-Anni Ann.ti	5,13
5-Anni Ann.ti	4,12
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 11/03/2025

**Rendimenti**

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	2,50	2,02	1,51	1,02
2023	2,22	2,37	1,83	1,99
2022	-0,61	-2,84	-0,95	2,17
2021	0,56	0,41	0,41	-0,11

**Portafoglio 31/01/2025**

**Asset Allocation %**

Asset Class	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	98,71
Liquidità	1,29
Altro	0,00

**Fixed Income**
**Style Box™**


Sensibilità ai Tassi

**Duration Effettiva**

-

**Maturità effettiva**

-

**Qualità Credito Media**

-

**Credit Quality %**

Fond

0

Fond

0

**Titoli principali**

Nome	Settore	%
HOMES 2025-AFC1 TRUST 6.031%	-	2,15
Satus 2024-1 PLC 6.75552%	-	1,82
Elstree Funding No.5 PLC...	-	1,59
Dowson 2024-1 PLC 6.30468%	-	1,38
Mulcair Securities No.3...	-	1,38
UK Logistics 2024-1...	-	1,37
Black Diamond CLO 2017-2...	-	1,32
Signal Harmonic CLO II...	-	1,30
Pavillion Mortgages 2021-1...	-	1,27
Elstree Funding No 2 PLC...	-	1,21
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		14,80
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		172

**Fixed Income Sector Weightings %**

Settore	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,92
Cartolarizzazioni	97,79
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	36,97
Derivati	-35,68
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>
0 coupon	1,14
Da 0 a 4 cedole	13,18
Da 4 a 6 cedole	52,87
Da 6 a 8 cedole	30,88
Da 8 a 10 cedole	1,94
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	1,37
da 5 a 7	20,00
da 7 a 10	15,43
da 10 a 15	28,32
da 15 a 20	5,75
da 20 a 30	3,40
oltre 30	25,74

**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	EUR	T.E.R.	0,39%
Telefono	-	UCITS	Si	Spese correnti	0,39%
Web	www.bluebayinvest.com	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data di Partenza	07/06/2019	ISIN	LU1960063037		
Nome del Gestore	Sid Chhabra				
	Tom Mowl				
Data Inizio Gestione	20/04/2021				
NAV (11/03/2025)	EUR 121,51				
Patrimonio Netto (Mln)	427,94 EUR				

(31/01/2025)