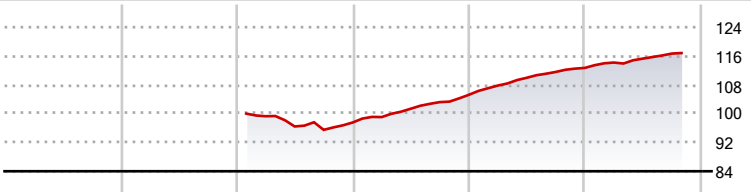
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund M EUR

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.

Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-10	
-	-	-	7,86	7,11	3,66	● Fondo

Misure di Rischio

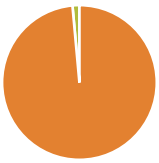
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	3,50
3Y Beta	-	3Y Std Dev	1,05
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,98
6-Mesi	2,54
1-Anno	4,19
3-Anni Ann.ti	6,68
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 03/11/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	1,32	0,95	1,22	-
2024	2,45	2,00	1,48	0,99
2023	1,54	2,34	1,81	1,96
2022	-	-2,87	-0,97	2,15
2021	-	-	-	-

Portafoglio 30/09/2025



Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	98,56
● Liquidità	1,44
● 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	%
Pclf 2025-1 A Regs	—	2,14
Latitude Aust Personal Loans...	—	1,63
Golden Bar (Securitisation)...	—	1,61
Beckett Mortgages 2025-1...	—	1,46
HOMES 2025-NQM4 TRUST 5.22%	—	1,41
Satus 2024-1 PLC 6.02094%	—	1,33
Jpmf 8 A Regs	—	1,31
Odys 2025-1 B Regs	—	1,16
Arini European CLO II...	—	1,05
Santander Consumo 8 Fondo de...	—	1,01
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		14,12
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		198

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	5,05
Cartolarizzazioni	93,51
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	28,61
Derivati	-27,17

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	5,60
Da 0 a 4 cedole	34,50
Da 4 a 6 cedole	49,84
Da 6 a 8 cedole	10,05
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	0,33
da 3 a 5	0,39
da 5 a 7	11,67
da 7 a 10	15,42
da 10 a 15	41,03
da 15 a 20	7,67
da 20 a 30	1,69
oltre 30	21,81

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.
Telefono	-
Web	www.bluebayinvest.com
Data di Partenza	19/11/2019
Nome del Gestore	Sid Chhabra Tom Mowl
Data Inizio Gestione	20/04/2021
NAV (03/11/2025)	EUR 116,89
Patrimonio Netto (MIn)	573,89 EUR
(30/09/2025)	

Patrimonio Classe (MIn)	-
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1960062815

Investimento Min. Ingresso	10.000 EUR
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,49%
Spese correnti	0,49%
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.