

# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund S 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™**

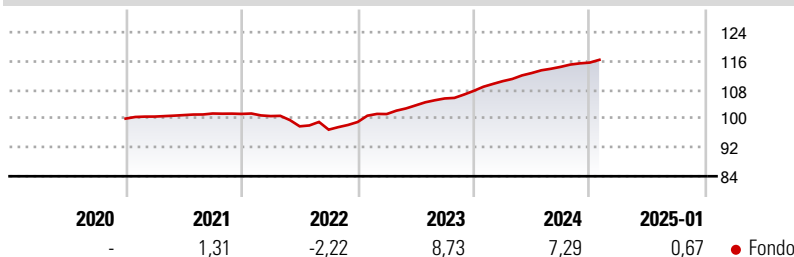
Senza rating

**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	0,96
3Y Beta	-	3Y Std Dev	2,63
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

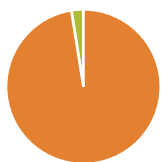
**Rendimenti**

**Rend. Cumulati %**

Periodo	Fondo
3-Mesi	1,19
6-Mesi	2,59
1-Anno	6,92
3-Anni Ann.ti	4,70
5-Anni Ann.ti	3,46
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 03/02/2025

**Rendimenti**

Periodo	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	2,51	2,04	1,52	1,03
2023	2,23	2,38	1,85	2,00
2022	-0,59	-2,83	-0,94	2,19
2021	0,57	0,41	0,43	-0,11

**Portafoglio 31/12/2024**

**Asset Allocation %**

Categoria	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	97,49
Liquidità	2,51
Altro	0,00

**Fixed Income**
**Style Box™**

Qualità Credito	Sensibilità ai Tassi		
	Bassa	Med	Alta
Alto			
Med			
Basso			

Caratteristica	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturità effettiva	-
Qualità Credito Media	-

**Credit Quality %**

Fond	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %
0	0	0	0

**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
<b>Coupon Range %</b>	<b>Fondo</b>
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	EUR	T.E.R.	0,34%
Telefono	-	UCITS	Si	Spese correnti	0,34%
Web	www.bluebayinvest.com	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data di Partenza	31/01/2020	ISIN	LU1960063201		
Nome del Gestore	Sid Chhabra				
	Tom Mowl				
Data Inizio Gestione	20/04/2021				
NAV (03/02/2025)	EUR 118,56				
Patrimonio Netto (Mln)	375,00 EUR				

(31/12/2024)