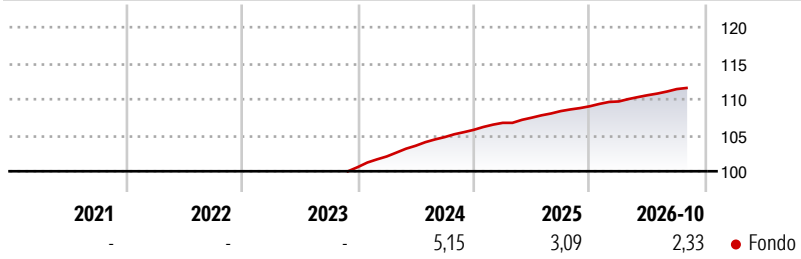
BlueBay Funds - BlueBay High Grade Short Duration Asset-Backed Credit Fund G EUR

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



Misure di Rischio

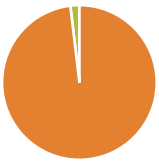
3Y Alpha	-	3Y Sharpe Ratio	-
3Y Beta	-	3Y Std Dev	-
3Y R-Squared	-	3Y Risk	-
3Y Info Ratio	-	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	-	10Y Risk	-

Rend. Cumulati %	Fondo
3-Mesi	0,69
6-Mesi	1,43
1-Anno	2,79
3-Anni Ann.ti	-
5-Anni Ann.ti	-
10-Anni Ann.ti	-

Rendimenti aggiornati al 12/11/2026

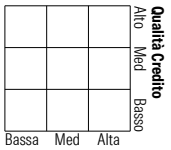
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,61	0,79	0,77	-
2025	0,92	0,67	0,85	0,62
2024	1,47	1,46	1,16	0,96
2023	-	-	-	-
2022	-	-	-	-

Portafoglio 30/09/2026



Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	101,95
Liquidità	-1,95
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	

Credit Quality %	Fondo	Credit Quality %	Fondo

Titoli principali

Nome	Settore	%
St. Paul's CLO VIII DAC 3.69%	—	2,33
Dartry Park CLO Designated...	—	2,09
Sunri 2026-2 A Regs	—	2,05
Madison Park Euro Funding...	—	2,01
Ciret 26 A Regs	—	2,01
Auto1 Car Funding S.a.r.l....	—	1,92
Pembroke Property Finance 3...	—	1,89
Stratton BTL Mortgage...	—	1,89
Horizon 2026-1 Trust 5.4443%	—	1,85
Quarzo S.r.l. 3.467%	—	1,76
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		19,80
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		88

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	101,95
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	27,84
Derivati	-29,79

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	3,20
Da 0 a 4 cedole	52,76
Da 4 a 6 cedole	43,07
Da 6 a 8 cedole	0,98
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	0,00
da 3 a 5	7,02
da 5 a 7	15,39
da 7 a 10	24,36
da 10 a 15	6,58
da 15 a 20	13,55
da 20 a 30	7,07
oltre 30	26,04

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.
Telefono	-
Web	www.bluebayinvest.com
Data di Partenza	29/11/2023
Nome del Gestore	Ashley Blatter Sid Chhabra Tom Mowl Scott Spurling
Data Inizio Gestione	20/11/2020
NAV (12/11/2026)	EUR 111,69
Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2026)	199,79 EUR
Patrimonio Classe (Mln) (10/11/2026)	34,16 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU2249766747
Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	0,29%
Spese correnti	0,29%
Commissione di incentivo	-

See disclosures for more details

© 2026 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.

MORNINGSTAR