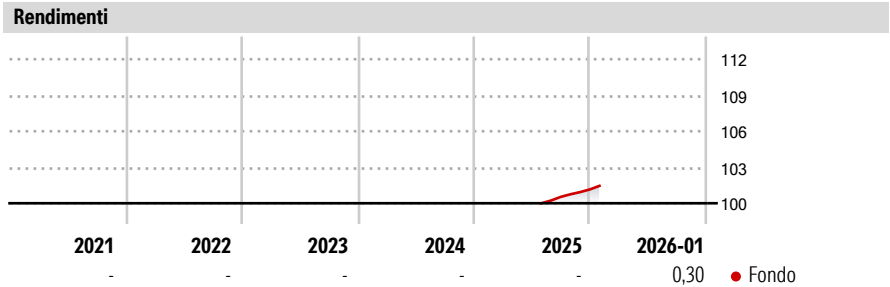


BlueBay Funds - BlueBay High Grade Short Duration Asset-Backed Credit Fund Q EUR

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.



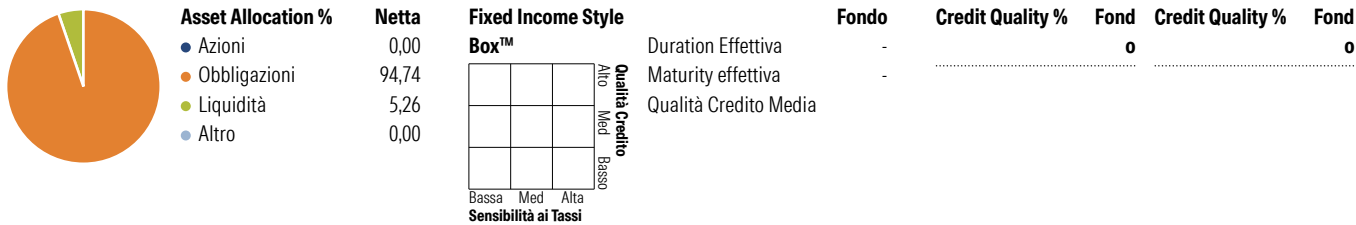
Misure di Rischio

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	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,74	Trimestrali %				
6-Mesi	1,48	2026	-	-	-	-
1-Anno	-	2025	-	-	-	0,62
3-Anni Ann.ti	-	2024	-	-	-	-
5-Anni Ann.ti	-	2023	-	-	-	-
10-Anni Ann.ti	-	2022	-	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 11/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



Titoli principali

Nome	Settore	%
Finance Ireland Rmbs No. 7...	—	2,88
St. Paul's CLO VIII DAC 3.216%	—	2,84
Domi 2021-1 BV 3.1%	—	2,62
Finance Ireland Auto...	—	2,35
Signal Harmonic CLO II...	—	2,28
Santander Residential 1 FT...	—	2,26
Jubilee Place 5 B.V. 3.416%	—	2,15
Red & Black Auto Germany 11...	—	2,12
DOWSON 2025-1 PLC 4.73669%	—	2,07
Avanti AU Auto ABS Trust...	—	1,90
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		23,48
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		71

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	0,00
Societario	0,00
Cartolarizzazioni	94,74
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	14,01
Derivati	-8,76
Coupon Range %	Fondo
0 coupon	0,00
Da 0 a 4 cedole	71,86
Da 4 a 6 cedole	28,14
Da 6 a 8 cedole	0,00
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	4,21
da 5 a 7	25,42
da 7 a 10	25,44
da 10 a 15	12,02
da 15 a 20	8,51
da 20 a 30	3,87
oltre 30	20,54

Anagrafica

Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	Patrimonio Classe (Mln)	6,78 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	-	(11/02/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bluebayinvest.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	0,34%
Data di Partenza	09/07/2025	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	0,34%
Nome del Gestore	Tom Mowl	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
	Ashley Blatter	Inc/Acc	Acc		
	Sid Chhabra	ISIN	LU2249767125		
	Scott Spurling				
Data Inizio Gestione	19/11/2020				
NAV (11/02/2026)	EUR 101,77				
Patrimonio Netto (Mln)	221,74 EUR				
(31/12/2025)					