

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund S USD

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™

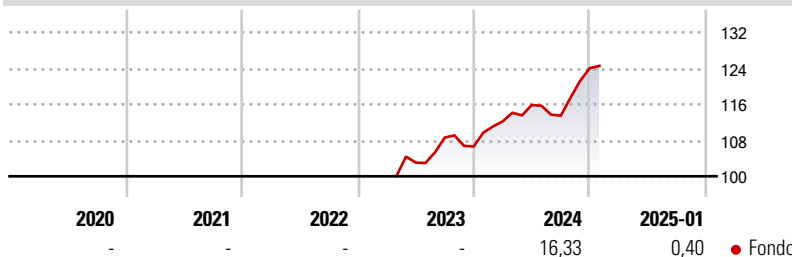
Senza rating

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.

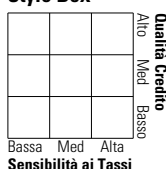
Misure di Rischio

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

Rendimenti

Portafoglio 31/12/2024

Asset Allocation %

● Azioni	0,00
● Obbligazioni	97,49
● Liquidità	2,51
● Altro	0,00

Fixed Income
Style Box™


Sensibilità ai Tassi

Duration Effettiva

-

Maturità effettiva

-

Qualità Credito Media

-

Fondo
Credit Quality %

0

0

0

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 %

	Fondo
🏠 Governativo	0,00
⚙️ Societario	1,06
🏠 Cartolarizzazioni	96,43
🏠 Enti Locali	0,00
🏠 Liquidità ed equivalenti	34,35
🏠 Derivati	-31,84
Coupon Range %	Fondo
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 %

	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	USD	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	25/04/2023	ISIN	LU1960063110		
Nome del Gestore	Sid Chhabra				
	Tom Mowl				
Data Inizio Gestione	20/04/2021				
NAV (03/02/2025)	USD 117,46				
Patrimonio Netto (Mln)	375,00 EUR				

(31/12/2024)