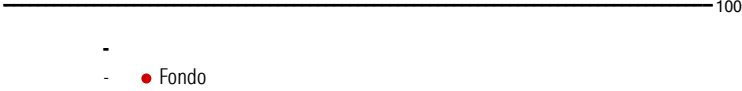


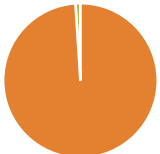
BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Asset-Backed Credit Fund R USD (MIDiv)

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	Rendimenti
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	Rend. Cumulati %	Fondo	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3Y Alpha	3Y Sharpe Ratio	-	3-Mesi	-	-	-	-
3Y Beta	3Y Std Dev	-	6-Mesi	2026	-	-	-
3Y R-Squared	3Y Risk	-	1-Anno	2025	-	-	-
3Y Info Ratio	5Y Risk	-	3-Anni Ann.ti	2024	-	-	-
3Y Tracking Error	10Y Risk	-	5-Anni Ann.ti	2023	-	-	-
		-	10-Anni Ann.ti	2022	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 27/07/2026

Portafoglio 30/06/2026										
	Asset Allocation %		Netta	Fixed Income Style Box™		Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
	● Azioni		0,00	<						

Titoli principali	Fixed Income Sector Weightings %	Fondo	Scadenze %	Fondo
Nome	Settore	%		
WISR Momentum Trust 2026-1...	—	2,03	da 1 a 3	0,00
Polaris 2026-2 PLC 4.62556%	—	1,85	da 3 a 5	4,01
Satus 2024-1 PLC 5.78285%	—	1,77	da 5 a 7	6,91
Fairbridge 2025-1 BV 3.145%	—	1,59	da 7 a 10	19,57
Uk Logistics 2026-2 DAC...	—	1,51	da 10 a 15	35,11
Bumper NL 2025-1 BV 2.879%	—	1,27	da 15 a 20	4,41
Taurus 2025-1 Eu Designated...	—	1,20	da 20 a 30	2,75
Domi 2026-1 BV 2.892%	—	1,18	oltre 30	27,25
Finance Ireland Auto...	—	1,13		
Aqueduct European Clo 5-2020...	—	1,06		
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		14,61		
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0		
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		241		

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	4,61
Da 0 a 4 cedole	25,77
Da 4 a 6 cedole	63,86
Da 6 a 8 cedole	5,76
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

Anagrafica	Patrimonio Classe (Mln)	Investimento Min. Ingresso	Investimento Min. Successivo
Società di Gestione	BlueBay Funds Management Company S.A.	0,55 USD	10.000 EUR
Telefono	-	(27/07/2026)	-
Web	www.bluebayinvest.com	LUSSEMBURGO	T.E.R.
Data di Partenza	01/07/2026	Valuta del Fondo	1,14%
Nome del Gestore	Sid Chhabra	UCITS	Spese correnti
	Tom Mowl	Inc/Acc	Commissione di incentivo
Data Inizio Gestione	20/04/2021	ISIN	-
NAV (27/07/2026)	USD 100,28		
Patrimonio Netto (Mln)	785,85 EUR		

(30/06/2026)

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 produttrici; (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.