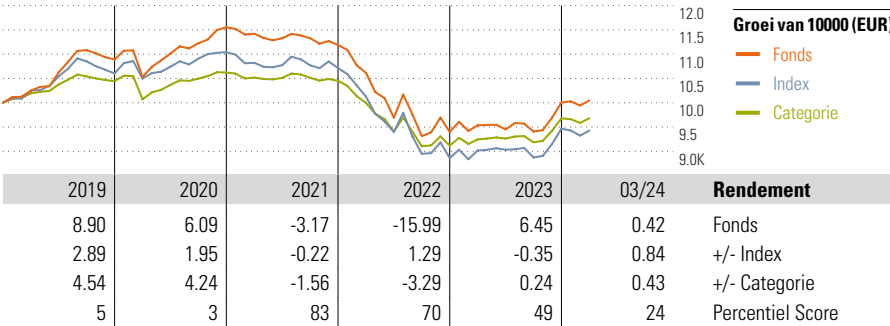


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund R - EUR (AIDiv)

Morningstar Medalist Rating™  Bronze	Morningstar Categorie Index Morningstar Eurozone Core Bond GR EUR Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR	Morningstar Rating™ ★★★★	Morningstar Categorie™ Obligaties Euro Gediversifieerd
--	--	---	------------------------------------	--

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the Bloomberg Euro Aggregate Index, by investing in a portfolio of investment grade-rated fixed income securities while taking into account ESG considerations. 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...



Risicomaatstaven			
Alpha	0.26	Sharpe Ratio	-0.72
Beta	0.98	Std Deviatie	7.39
R-kwadraat	90.98	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.15	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	2.18	10-jr Risico	Bov gem

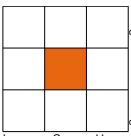
Berekeningen met Morningstar EZN Core Bd GR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (26 apr 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.12	0.65	0.45
6 Maanden	6.01	1.08	1.34
1 jaar	4.62	1.17	0.92
3 jr gean.	-4.33	0.50	-0.81
5 jr gean.	-0.71	1.23	0.72

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	0.42	-	-	-
2023	1.44	-0.86	-0.48	6.35
2022	-5.10	-8.69	-3.92	0.91
2021	-1.15	-0.82	0.01	-1.24
2020	-3.32	4.61	1.91	2.93

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	122.11	67.26	54.85
Kas/ geldmarkt	60.48	16.07	44.41
Overig	0.74	0.00	0.74

Morningstar Vastrentende Style Box™		
	Tijdsduur	-
	Effectieve Looptijd	8.90
	Gem Krediet	BBB
	Kwaliteit	

Kredietkwalite it	% Oblg	% Oblg
AAA	14.00	BBB 39.95
AA	15.22	BB 6.66
A	24.17	B 0.00
		Below B 0.00
		Geen Rating 0.00

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities	% Port
Euro Schatz Future June 242024-06-06	15.17
Ultra 10 Year US Treasury Note Future...	6.67
France (Republic Of) 2.5%2030-05-25	4.34
Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31	3.18
Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30	2.37
Spain (Kingdom of) 3.25%2034-04-30	2.23
Mexico (United Mexican States)...	2.21
Euro Bobl Future June 242024-06-06	2.06
European Union 0%2028-10-04	1.95
Italy (Republic Of) 1.35%2030-04-01	1.91
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	225
% Van Vermogen In Top 10 Posities	42.11

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	7.30
3 tot 5 jaar	10.84
5 tot 7 jaar	12.93
7 tot 10 jaar	19.95
10 tot 15 jaar	10.08
15 tot 20 jaar	7.09
20 tot 30 jaar	8.00
Meer dan 30 jaar	2.41

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	8.55
0% tot 4%	60.23
4% tot 6%	24.77
6% tot 8%	5.60
8% tot 10%	0.85
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	6 dec 2012	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU0549543287		
Aanvangsdatum	1 dec 2016				
Koers (26 apr 2024)	EUR 108.36				
Fondsvermogen (mln)	EUR 6.99				