

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

Morningstar Medalist Rating™



Morningstar Categorie Index

Morningstar Eurozone Core Bond
GR EUR

Benchmark van het fonds

Bloomberg Euro Agg Bond TR
EUR

Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Obligaties Euro Gediversifieerd

Wordt gebruikt in dit rapport als index

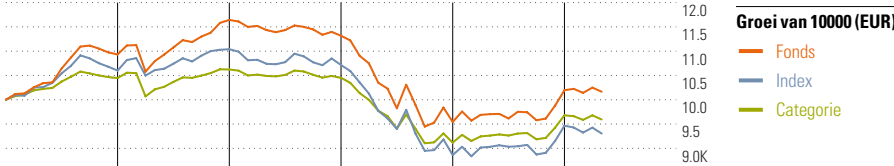
Beleggingsdoelstelling

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	0.76	Sharpe Ratio	-0.68
Beta	0.98	Std Deviatie	7.39
R-kwadraat	90.90	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.38	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	2.19	10-jr Risico	-

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



	2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Rendement
Fonds	9.32	6.50	-2.79	-15.68	6.85	-0.31	
+/- Index	3.30	2.36	0.15	1.60	0.05	1.40	
+/- Categorie	4.95	4.65	-1.19	-2.98	0.64	0.58	
Percentiel Score	4	3	73	67	37	29	

Rendementen (30 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.47	0.71	0.17
6 Maanden	3.11	1.49	1.20
1 jaar	5.37	2.74	1.80
3 jr gean.	-3.65	1.00	-0.37
5 jr gean.	-0.29	1.82	1.17

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	0.52	-	-	-
2023	1.54	-0.76	-0.38	6.45
2022	-5.01	-8.60	-3.83	1.01
2021	-1.06	-0.73	0.11	-1.14
2020	-3.23	4.71	2.01	3.03

Portefeuille 30 apr 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	150.86	67.25	83.61
Kas/ geldmarkt	27.40	11.67	15.73
Overig	0.66	0.00	0.66

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	Effectieve Looptijd	Gem Krediet	Kwaliteit
	-	8.90	BBB	

Laag Gem Hoog
Kredietkwaliteit
Rentegevoeligheid

Kredietkwalite

it			
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
2 Year Treasury Note Future June...	26.63
Euro Schatz Future June 242024-06-06	17.73
Ultra 10 Year US Treasury Note Future...	6.68
France (Republic Of) 2.5%2030-05-25	4.23
Euro Bobl Future June 242024-06-06	3.38
Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31	3.12
Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30	2.28
Spain (Kingdom of) 3.25%2034-04-30	2.15
Mexico (United Mexican States)...	2.12
European Union 0%2028-10-04	1.91
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	234
% Van Vermogen In Top 10 Posities	70.22

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	5.45
3 tot 5 jaar	9.54
5 tot 7 jaar	10.38
7 tot 10 jaar	15.99
10 tot 15 jaar	8.45
15 tot 20 jaar	5.61
20 tot 30 jaar	5.86
Meer dan 30 jaar	2.46

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	8.59
0% tot 4%	59.29
4% tot 6%	26.20
6% tot 8%	5.06
8% tot 10%	0.87
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fonds informatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	500,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	26 jun 2014	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU0549545654		
Aanvangsdatum	1 dec 2016				
Koers (30 mei 2024)	EUR 103.07				
Fondsvermogen (mln)	EUR 27.96				