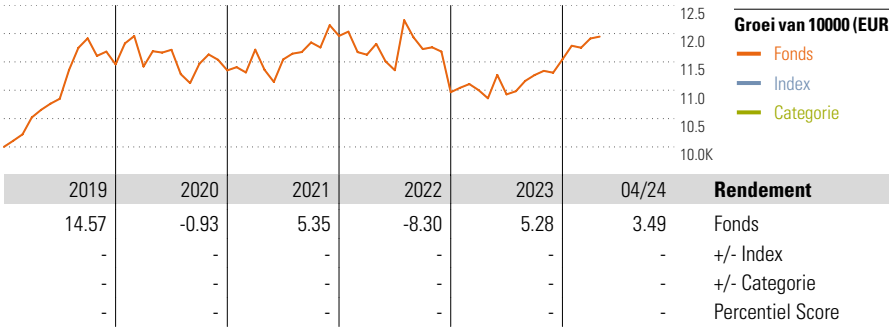


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund B - USD

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR	—	Obligaties Overig

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			Rendementen (15 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	-	Sharpe Ratio	0.08	3 Maanden	0.71	-	2024	3.20	-	-	-
Beta	-	Std Deviatie	8.34	6 Maanden	6.19	-	2023	0.34	-0.68	3.11	2.45
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar	7.87	-	2022	-2.77	-2.35	3.29	-6.49
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gea.	2.12	-	2021	3.22	-1.47	2.60	0.97
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gea.	2.30	-	2020	-0.34	2.59	-2.11	-1.01

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™	Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg			
Aandelen	0.00	0.00	0.00	Laag Gem Hoog Rentegevoeligheid	Tijdsduur	-	AAA	14.00	BBB	39.95
Obligaties	122.11	67.26	54.85		Effectieve Looptijd	8.90	AA	15.22	BB	6.66
Kas/ geldmarkt	60.48	16.07	44.41		Gem Krediet	BBB	A	24.17	B	0.00
Overig	0.74	0.00	0.74		Kwaliteit				Below B	0.00
								Geen Rating	0.00	

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblg	Couponverdeling	% Oblg
Euro Schatz Future June 242024-06-06	15.17	1 tot 3 jaar	7.30	0% PIK	8.55
Ultra 10 Year US Treasury Note Future...	6.67	3 tot 5 jaar	10.84	0% tot 4%	60.23
France (Republic Of) 2.5%2030-05-25	4.34	5 tot 7 jaar	12.93	4% tot 6%	24.77
Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31	3.18	7 tot 10 jaar	19.95	6% tot 8%	5.60
Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30	2.37	10 tot 15 jaar	10.08	8% tot 10%	0.85
Spain (Kingdom of) 3.25%2034-04-30	2.23	15 tot 20 jaar	7.09	10% tot 12%	0.00
Mexico (United Mexican States)...	2.21	20 tot 30 jaar	8.00	Meer dan 12%	0.00
Euro Bobl Future June 242024-06-06	2.06	Meer dan 30 jaar	2.41		
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				

Fondsinformatie					
Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	100,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	28 mei 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU0549543527		
Aanvangsdatum	1 dec 2016				
Koers (15 mei 2024)	USD 178.30				
Fondsvermogen (mln)	USD 1.66				