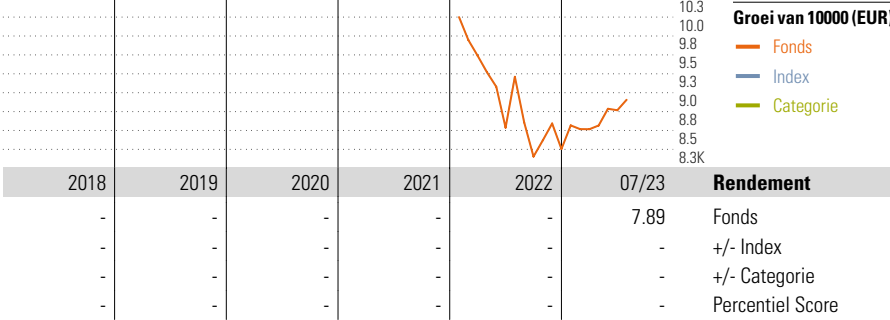


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Bond Fund M - GBP

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	Markit iBoxx EUR Corp TR	—	Obligaties Overig

Beleggingsdoelstelling

Het Bluebay Investment Grade Bond heeft als doel om een totaalrendement te behalen bovenop dat van de iBoxx Euro Corporates Index (een samenstelling van deze index is beschikbaar op de website van Deutsche Bank) door te beleggen in investment-grade obligaties.



Risicomaatstaven									
Alpha	-	Sharpe Ratio	-	3 Maanden	2.76	-	-	2023	3.17
Beta	-	Std Deviatie	-	6 Maanden	4.65	-	-	2022	-
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar	0.46	-	-		-10.03
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gean.	-	-	-		-4.48
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gean.	-	-	-		1.23

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™	Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg
Aandelen	0.00	0.00	0.00	Tijdsduur	-		
Obligaties	129.86	52.10	77.76	Effectieve Looptijd	5.94	AAA	7.58
Kas/ geldmarkt	47.82	26.96	20.86	Gem Krediet	BBB	AA	2.48
Overig	1.37	0.00	1.37	Kwaliteit		A	23.86
							Below B
							Geen Rating

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblg	Couponverdeling	% Oblg
Euro Schatz Future June 242024-06-06	24.34	1 tot 3 jaar	4.74	0% PIK	0.00
Euro Bobl Future June 242024-06-06	11.69	3 tot 5 jaar	7.79	0% tot 4%	45.89
Germany (Federal Republic Of)...	3.50	5 tot 7 jaar	14.57	4% tot 6%	43.41
Germany (Federal Republic Of)...	2.50	7 tot 10 jaar	22.02	6% tot 8%	8.59
Toyota Motor Credit Corp. 4.05%2029-09-13	1.21	10 tot 15 jaar	11.02	8% tot 10%	2.11
UBS Group AG 2.875%2031-04-02	1.14	15 tot 20 jaar	3.03	10% tot 12%	0.00
Eurogrid GmbH 3.722%2030-04-27	1.12	20 tot 30 jaar	1.79	Meer dan 12%	0.00
UBS Group AG 7.75%2028-03-01	0.96	Meer dan 30 jaar	1.76		
Vestas Wind Systems AS 4.125%2031-06-1E	0.95				
Upjohn Finance B.V 1.908%2032-06-23	0.91				
Totaal Aantal Aandelen	0				
Totaal Aantal Obligaties	222				
% Van Vermogen In Top 10 Posities	48.31				

Fondsinformatie					
Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	GBP	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	31 jan 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Andrzej Skiba	ISIN	LU0720462265		
Aanvangsdatum	1 dec 2008				
Koers (29 aug 2023)	GBP 90.64				
Fondsvermogen (mln)	GBP 0.10				