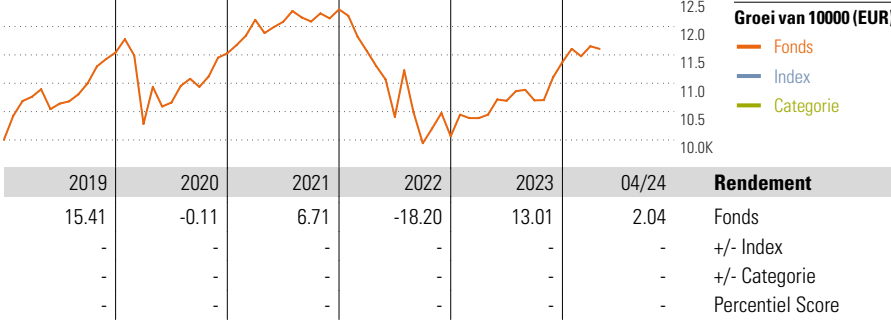


# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Bond Fund C - GBP

|                             |                          |                     |                        |
|-----------------------------|--------------------------|---------------------|------------------------|
| 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 | -0.17 |
| Beta             | - Std Deviatie | 9.90  |
| R-kwadraat       | - 3-jr Risico  | -     |
| Informatie Ratio | - 5-jr Risico  | -     |
| Tracking Error   | - 10-jr Risico | -     |

| Rendementen (2 mei 2024) | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|--------------------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden                | 0.40   | -      | -      |
| 6 Maanden                | 7.81   | -      | -      |
| 1 jaar                   | 11.01  | -      | -      |
| 3 jr gean.               | -0.83  | -      | -      |
| 5 jr gean.               | 1.18   | -      | -      |

| Kwartaalrendementen | 1e kw  | 2e kw  | 3e kw | 4e kw |
|---------------------|--------|--------|-------|-------|
| 2024                | 2.46   | -      | -     | -     |
| 2023                | 3.19   | 2.95   | 0.06  | 6.32  |
| 2022                | -5.98  | -10.02 | -4.48 | 1.23  |
| 2021                | 5.11   | -0.28  | 0.04  | 1.77  |
| 2020                | -10.91 | 3.66   | 2.60  | 5.42  |

**Portefeuille** 31 mrt 2024

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 0.00   | 0.00    | 0.00    |
| Obligaties     | 129.86 | 52.10   | 77.76   |
| Kas/ geldmarkt | 47.82  | 26.96   | 20.86   |
| Overig         | 1.37   | 0.00    | 1.37    |

| Morningstar Vastrentende Style Box™ |                     |      |
|-------------------------------------|---------------------|------|
|                                     | Tijdsduur           | -    |
|                                     | Effectieve Looptijd | 5.94 |
|                                     | Gem Krediet         | BBB  |
|                                     | Kwaliteit           |      |

| Kredietkwaliteit | % Oblg | % Oblg           |
|------------------|--------|------------------|
| AAA              | 7.58   | BBB 56.48        |
| AA               | 2.48   | BB 9.58          |
| A                | 23.86  | B 0.00           |
|                  |        | Below B 0.00     |
|                  |        | Geen Rating 0.03 |

Data per 31 dec 2023

| Top 10 Onderliggende posities             | % Port |
|-------------------------------------------|--------|
| Euro Schatz Future June 242024-06-06      | 24.34  |
| Euro Bobl Future June 242024-06-06        | 11.69  |
| Germany (Federal Republic Of)...          | 3.50   |
| Germany (Federal Republic Of)...          | 2.50   |
| Toyota Motor Credit Corp. 4.05%2029-09-13 | 1.21   |
| UBS Group AG 2.875%2031-04-02             | 1.14   |
| Eurogrid GmbH 3.722%2030-04-27            | 1.12   |
| UBS Group AG 7.75%2028-03-01              | 0.96   |
| 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  |

| Maturity-verdeling | % Oblg |
|--------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar       | 4.74   |
| 3 tot 5 jaar       | 7.79   |
| 5 tot 7 jaar       | 14.57  |
| 7 tot 10 jaar      | 22.02  |
| 10 tot 15 jaar     | 11.02  |
| 15 tot 20 jaar     | 3.03   |
| 20 tot 30 jaar     | 1.79   |
| Meer dan 30 jaar   | 1.76   |

| Couponverdeling | % Oblg |
|-----------------|--------|
| 0% PIK          | 0.00   |
| 0% tot 4%       | 45.89  |
| 4% tot 6%       | 43.41  |
| 6% tot 8%       | 8.59   |
| 8% tot 10%      | 2.11   |
| 10% tot 12%     | 0.00   |
| Meer dan 12%    | 0.00   |

**Fondsinformatie**

|                     |                             |                |              |                    |        |
|---------------------|-----------------------------|----------------|--------------|--------------------|--------|
| Fondsgroep          | BlueBay Funds Management... | Vestigingsland | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag | 10,000 |
| Telefoon            | -                           | Fondsvaluta    | GBP          | Min Additioneel    | -      |
| Website             | www.bluebayinvest.com       | UCITS          | ja           |                    |        |
| Oprichtingsdatum    | 28 jan 2013                 | Inc/Acc        | Acc          |                    |        |
| Fondsmanager        | Andrzej Skiba               | ISIN           | LU0842208760 |                    |        |
| Aanvangsdatum       | 1 dec 2008                  |                |              |                    |        |
| Koers (2 mei 2024)  | GBP 131.19                  |                |              |                    |        |
| Fondsvermogen (mln) | GBP 2.77                    |                |              |                    |        |