# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund S - EUR

**Morningstar Medalist Rating™**
Silver

**Morningstar Categorie Index**
Morningstar Eurozone Core Bond GR EUR
Wordt gebruikt in dit rapport als index

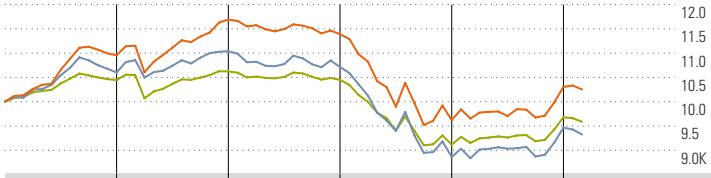
**Benchmark van het fonds**
Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR

**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...




| 2019 | 2020 | 2021 | 2022 | 2023 | 02/24 | Rendement |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 9.55 | 6.71 | -2.59 | -15.50 | 7.08 | -0.51 | Fonds |
| 3.54 | 2.58 | 0.36 | 1.78 | 0.28 | 0.98 | +/- Index |
| 5.19 | 4.87 | -0.98 | -2.80 | 0.87 | 0.46 | +/- Categorie |
| 3 | 2 | 69 | 66 | 30 | 28 | Percentiel Score |

**Risicomaatstaven**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Alpha | 0.89 | Sharpe Ratio | -0.66 |
| Beta | 0.99 | Std Deviatie | 7.35 |
| R-kwadraat | 90.95 | 3-jr Risico | Bov gem |
| Informatie Ratio | 0.42 | 5-jr Risico | Bov gem |
| Tracking Error | 2.17 | 10-jr Risico | Bov gem |

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

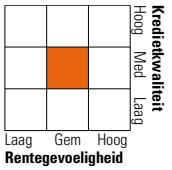
| **Rendementen** (27 mrt 2024) | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|---|---|---|---|
| 3 Maanden | 0.14 | 0.57 | 0.45 |
| 6 Maanden | 7.27 | 1.05 | 1.38 |
| 1 jaar | 5.82 | 1.29 | 0.98 |
| 3 jr gean. | -3.67 | 0.84 | -0.53 |
| 5 jr gean. | 0.21 | 1.87 | 1.35 |

| **Kwartaalrendementen** | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|---|---|---|---|---|
| 2023 | 1.59 | -0.71 | -0.33 | 6.52 |
| 2022 | -4.96 | -8.56 | -3.78 | 1.06 |
| 2021 | -1.00 | -0.68 | 0.16 | -1.09 |
| 2020 | -3.18 | 4.76 | 2.07 | 3.07 |
| 2019 | 2.62 | 3.84 | 4.47 | -1.59 |

## Portefeuille 29 feb 2024

| **Assetverdeling** | % Long | % Short | % Netto |
|---|---|---|---|
| Aandelen | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| Obligaties | 124.59 | 68.49 | 56.10 |
| Kas/ geldmarkt | 56.56 | 13.38 | 43.18 |
| Overig | 0.72 | 0.00 | 0.72 |

**Morningstar Vastrentende Style Box™**




| | |
|---|---|
| Tijdsduur | - |
| Effectieve Looptijd | 8.90 |
| Gem Krediet | BBB |
| Kwaliteit | |

| **Kredietkwaliteit** | % 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 per31 dec 2023

| **Top 10 Onderliggende posities** | % Port |
|---|---|
| Euro Schatz Future Mar 242024-03-07 | 17.49 |
| Ultra 10 Year US Treasury Note Future... | 6.61 |
| France (Republic Of) 2.5%2030-05-25 | 4.33 |
| Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31 | 3.18 |
| Euro OAT Future Mar 242024-03-07 | 3.02 |
| Euro Bobl Future Mar 242024-03-07 | 2.34 |
| Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30 | 2.34 |
| Mexico (United Mexican States)... | 2.25 |
| European Union 0%2028-10-04 | 1.94 |
| Italy (Republic Of) 1.35%2030-04-01 | 1.90 |
| Totaal Aantal Aandelen | 0 |
| Totaal Aantal Obligaties | 225 |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities | 45.42 |

| **Maturity-verdeling** | % Oblg |
|---|---|
| 1 tot 3 jaar | 7.13 |
| 3 tot 5 jaar | 10.07 |
| 5 tot 7 jaar | 12.68 |
| 7 tot 10 jaar | 20.24 |
| 10 tot 15 jaar | 8.83 |
| 15 tot 20 jaar | 6.42 |
| 20 tot 30 jaar | 7.47 |
| Meer dan 30 jaar | 2.39 |

| **Couponverdeling** | % Oblg |
|---|---|
| 0% PIK | 8.68 |
| 0% tot 4% | 60.04 |
| 4% tot 6% | 24.38 |
| 6% tot 8% | 6.00 |
| 8% tot 10% | 0.90 |
| 10% tot 12% | 0.00 |
| Meer dan 12% | 0.00 |

## Fondsinformatie

| | |
|---|---|
| Fondsgroep | BlueBay Funds Management... |
| Telefoon | - |
| Website | www.bluebayinvest.com |
| Oprichtingsdatum | 5 dec 2013 |
| Fondsmanager | Kaspar Hense |
| Aanvangsdatum | 1 dec 2016 |
| Koers (27 mrt 2024) | EUR 132.39 |
| Fondsvermogen (mln) | EUR 20.50 |

| | |
|---|---|
| Vestigingsland | Luxemburg |
| Fondsvaluta | EUR |
| UCITS | ja |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | LU0995160461 |

| | |
|---|---|
| Min Aanvangsbedrag | 10,000 |
| Min Additioneel | - |

© 2024 Morningstar Benelux. Alle rechten voorbehouden. De informatie aangaande beleggingsfondsen en de fondsportefeuille in dit document weergegeven: (1) is eigendom van Morningstar en is in licentie verstrekt, (2) mag uitsluitend gebruikt worden conform de contractueel opgestelde licentievoorwaarden, (3) dient informatieve doeleinden en mag niet opgevat worden als beleggingsadvies van Morningstar, (4) is met grote zorg samengesteld maar kan desondanks onjuistheden bevatten. Morningstar aanvaardt geen enkele aansprakelijkheid voor beslissingen gebaseerd op de weergegeven informatie.