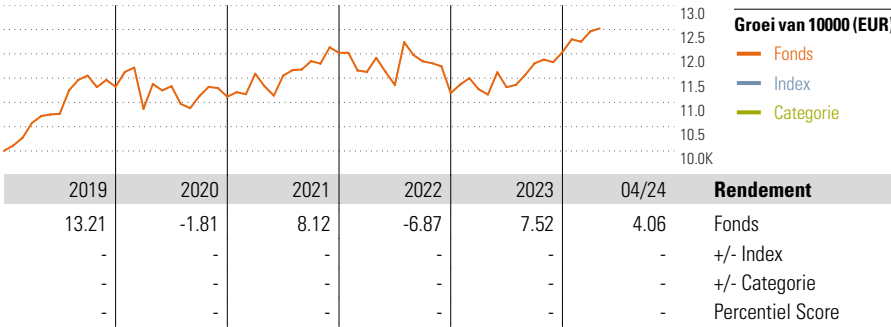


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Bond Fund S - USD (AIDiv)

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				Rendementen (7 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	-	Sharpe Ratio	0.29	3 Maanden	1.65	-	-	2024	3.54	-	-	-
Beta	-	Std Deviatie	8.12	6 Maanden	5.78	-	-	2023	0.70	0.38	4.32	1.97
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar	11.77	-	-	2022	-3.26	-2.30	4.28	-5.51
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gean.	3.69	-	-	2021	4.26	-0.33	2.59	1.42
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gean.	3.11	-	-	2020	-4.01	4.29	-1.79	-0.12

Portefeuille 31 mrt 2024												
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™			Kredietkwalite	% Oblg		% Oblg		
Aandelen	0.00	0.00	0.00	Hoog Med Laag Laag Gem Hoog	Tijdsduur	-	it					
Obligaties	129.86	52.10	77.76		Effectieve Looptijd	5.94	AAA	7.58	BBB	56.48		
Kas/ geldmarkt	47.82	26.96	20.86		Gem Krediet	BBB	AA	2.48	BB	9.58		
Overig	1.37	0.00	1.37		Kwaliteit		A	23.86	B	0.00		
											Below B	0.00
											Geen Rating	0.03

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	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	11 jun 2014	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Andrzej Skiba	ISIN	LU1050657441		
Aanvangsdatum	1 dec 2008				
Koers (7 mei 2024)	USD 110.91				
Fondsvermogen (mln)	USD 37.76				