

BlueBay Funds - BlueBay Total Return Credit Fund C - GBP

Morningstar Categorie Index

Morningstar Global Core Bond GR Hedged GBP

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

No benchmark

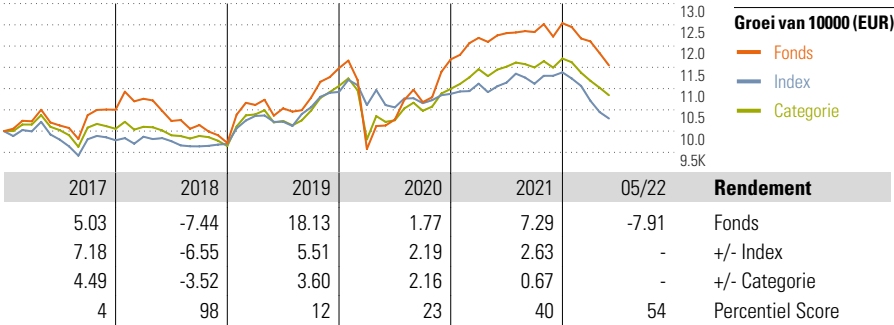
Morningstar Rating™

—

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed, does not reference any benchmark and aims to achieve a total return from investments in higher yielding fixed income asset classes through active security selection, asset allocation and capital preservation techniques while taking into account ESG considerations.



Risicomaatstaven

Alpha	3.67	Sharpe Ratio	0.42
Beta	0.96	Std Deviatie	11.64
R-kwadraat	16.00	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	0.39	5-jr Risico	-
Tracking Error	8.69	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar Gbl Core Bd GR Hdg GBP (waar van toepassing)

Rendementen (29 jun 2022)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-11.69	-10.56	-11.05
6 Maanden	-14.67	-19.64	-21.29
1 jaar	-13.08	-17.24	-20.70
3 jr gean.	0.44	3.15	1.09
5 jr gean.	1.06	1.75	0.03

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2022	-3.42	-	-	-
2021	4.33	0.92	0.21	1.69
2020	-16.59	7.23	4.01	9.40
2019	9.19	-0.74	2.40	6.44
2018	2.45	-4.85	-0.93	-4.16

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	1.17	0.54	0.63
Obligaties	117.19	10.46	106.72
Kas/ geldmarkt	104.66	119.71	-15.05
Overig	7.70	0.00	7.70

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	-
Effectieve Looptijd	6.36	
Gem Krediet	BB	
Kwaliteit		
Rentegevoeligheid		

Kredietkwaliteit

it			
AAA	2.98	BBB	27.23
AA	6.55	BB	32.20
A	14.56	B	14.03
		Below B	2.42
		Geen Rating	0.03

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities

	% Port
2 Year Treasury Note Future June...	26.31
5 Year Treasury Note Future June...	5.64
United States Treasury Notes...	2.48
BNP Paribas SA 7.75%2029-08-16	1.95
Intesa Sanpaolo S.p.A. 7.75%2027-01-11	1.12
Caixabank S.A. 5.875%2027-10-09	1.05
HSBC Holdings PLC 4.856%2032-05-23	1.00
Deutsche Bank AG 10%2027-12-01	0.96
ABN AMRO Bank N.V. 4.375%2025-09-22	0.93
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A....	0.88
Totaal Aantal Aandelen	1
Totaal Aantal Obligaties	347
% Van Vermogen In Top 10 Posities	42.33

Maturity-verdeling

	% Oblg
1 tot 3 jaar	9.94
3 tot 5 jaar	17.15
5 tot 7 jaar	12.30
7 tot 10 jaar	12.01
10 tot 15 jaar	11.65
15 tot 20 jaar	2.88
20 tot 30 jaar	2.91
Meer dan 30 jaar	2.32

Couponverdeling

	% Oblg
0% PIK	5.41
0% tot 4%	11.55
4% tot 6%	24.33
6% tot 8%	37.37
8% tot 10%	18.98
10% tot 12%	1.98
Meer dan 12%	0.39

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	-
Telefoon	-	Fondsvaluta	GBP	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	31 dec 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Not Disclosed	ISIN	LU1105492372		
Aanvangsdatum	1 jan 2022				
Koers (29 jun 2022)	GBP 110.22				
Fondsvermogen (mln)	GBP 0.41				