

BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund Q - EUR

Morningstar Medalist Rating™

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	04/24	Rendement
Fonds	9.49	6.67	-2.64	-15.54	7.02	-0.26	Fonds
Index	3.48	2.53	0.31	1.74	0.22	1.45	+/- Index
Categorie	5.13	4.82	-1.03	-2.84	0.81	0.63	+/- Categorie
Percentiel Score	3	2	69	67	32	28	

Risicomaatstaven				Rendementen (15 mei 2024)				Kwartaalrendementen				
Alpha	0.92	Sharpe Ratio	-0.66	Rend %	+/-Idx	+/-Cat		1e kw	2e kw	3e kw	4e kw	
Beta	0.98	Std Deviatie	7.39	3 Maanden	1.29	0.38	0.34	2024	0.56	-	-	-
R-kwadraat	90.90	3-jr Risico	Bov gem	6 Maanden	5.41	1.85	1.59	2023	1.57	-0.73	-0.34	6.50
Informatie Ratio	0.45	5-jr Risico	Bov gem	1 jaar	6.16	1.88	1.79	2022	-4.98	-8.57	-3.79	1.05
Tracking Error	2.19	10-jr Risico	-	3 jr gean.	-3.06	1.06	-0.14	2021	-1.01	-0.69	0.14	-1.10
				5 jr gean.	0.12	1.92	1.39	2020	-3.18	4.75	2.05	3.07

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

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	122.11	67.26	54.85
Kas/ geldmarkt	60.48	16.07	44.41
Overig	0.74	0.00	0.74

Morningstar Vastrentende Style Box™

	Tijdsduur	-
Effectieve Looptijd	8.90	
Gem Krediet	BBB	
Kwaliteit		

Kredietkwaliteit

% Oblg	% Oblg
AAA	14.00
AA	15.22
A	24.17
Below B	0.00
Geen Rating	0.00

Top 10 Onderliggende posities

% Port	
Euro Schatz Future June 242024-06-06	15.17
Ultra 10 Year US Treasury Note Future...	6.67
France (Republic Of) 2.5%2030-05-25	4.34
Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31	3.18
Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30	2.37
Spain (Kingdom of) 3.25%2034-04-30	2.23
Mexico (United Mexican States)...	2.21
Euro Bobl Future June 242024-06-06	2.06
European Union 0%2028-10-04	1.95
Italy (Republic Of) 1.35%2030-04-01	1.91
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	225
% Van Vermogen In Top 10 Posities	42.11

Maturity-verdeling

% Oblg	
1 tot 3 jaar	7.30
3 tot 5 jaar	10.84
5 tot 7 jaar	12.93
7 tot 10 jaar	19.95
10 tot 15 jaar	10.08
15 tot 20 jaar	7.09
20 tot 30 jaar	8.00
Meer dan 30 jaar	2.41

Couponverdeling

% Oblg	
0% PIK	8.55
0% tot 4%	60.23
4% tot 6%	24.77
6% tot 8%	5.60
8% tot 10%	0.85
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.00

Fondsinformatie					
Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10.000
Telefoon	-	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	15 apr 2016	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU1170327289		
Aanvangsdatum	1 dec 2016				
Koers (15 mei 2024)	EUR 112.46				
Fondsvermogen (mln)	-				

© 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.