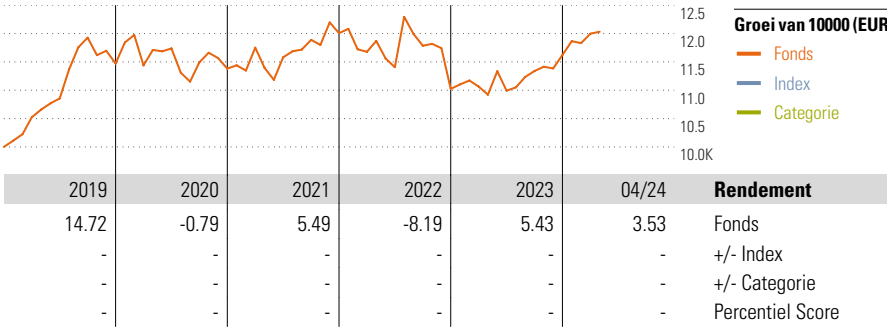


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund I - USD

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR	—	Obligaties Overig

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...



Risicomaatstaven			Rendementen (15 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	-	Sharpe Ratio	0.10	3 Maanden	0.74	-	2024	3.23	-	-	-
Beta	-	Std Deviatie	8.34	6 Maanden	6.26	-	2023	0.38	-0.65	3.15	2.49
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar	8.02	-	2022	-2.74	-2.32	3.32	-6.47
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gean.	2.26	-	2021	3.25	-1.44	2.64	1.00
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gean.	2.44	-	2020	-0.30	2.62	-2.08	-0.98

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™

Laag	Gem	Hoog	Laag	Hoog
Rentegevoeligheid				

Kredietkwaliteit

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 per 31 dec 2023

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

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblg
Euro Schatz Future June 242024-06-06	15.17	1 tot 3 jaar	7.30
Ultra 10 Year US Treasury Note Future...	6.67	3 tot 5 jaar	10.84
France (Republic Of) 2.5%2030-05-25	4.34	5 tot 7 jaar	12.93
Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31	3.18	7 tot 10 jaar	19.95
Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30	2.37	10 tot 15 jaar	10.08
Spain (Kingdom of) 3.25%2034-04-30	2.23	15 tot 20 jaar	7.09
Mexico (United Mexican States)...	2.21	20 tot 30 jaar	8.00
Euro Bobl Future June 242024-06-06	2.06	Meer dan 30 jaar	2.41
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		

Fondsinformatie			
Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg
Telefoon	-	Fondsvaluta	USD
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja
Oprichtingsdatum	17 aug 2016	Inc/Acc	Acc
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU0549546033
Aanvangsdatum	1 dec 2016		
Koers (15 mei 2024)	USD 123.53		
Fondsvermogen (mln)	-		
Min Aanvangsbedrag			500,000
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 licentievooraarden, (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.