

# BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Government Bond Fund I EUR (QIDiv)

## Morningstar Medalist Rating™



## Morningstar Categorie Index

Morningstar Eurozone Treasury Bond GR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

## Benchmark van het fonds

Bloomberg Euro Agg Treasury TR EUR

## Morningstar Rating™

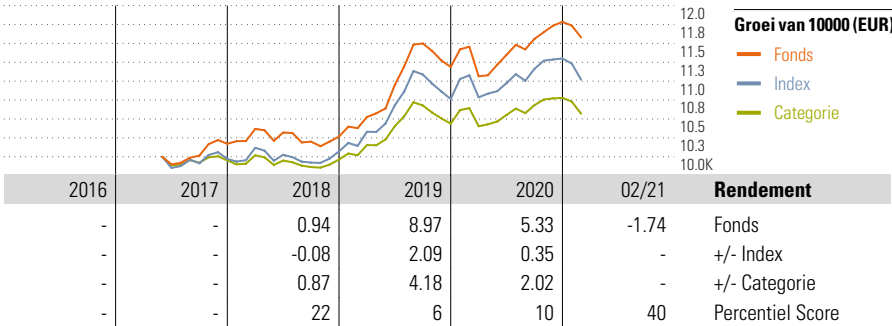
—

## Morningstar Categorie™

Obligaties Euro Overheid

### Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the Bloomberg Euro Aggregate Treasury 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...



### Risicomaatstaven

|                  |       |              |      |
|------------------|-------|--------------|------|
| Alpha            | 0.83  | Sharpe Ratio | 1.10 |
| Beta             | 1.00  | Std Deviatie | 4.37 |
| R-kwadraat       | 90.24 | 3-jr Risico  | -    |
| Informatie Ratio | 0.62  | 5-jr Risico  | -    |
| Tracking Error   | 1.36  | 10-jr Risico | -    |

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

### Rendementen (25 mrt 2021)

|            | Rend % | +/-Idx | +/-Cat |
|------------|--------|--------|--------|
| 3 Maanden  | -0.86  | -1.20  | -1.19  |
| 6 Maanden  | 0.82   | -2.30  | -1.91  |
| 1 jaar     | 7.08   | 3.72   | 4.19   |
| 3 jr gean. | 4.10   | 8.66   | 8.25   |
| 5 jr gean. | -      | -      | -      |

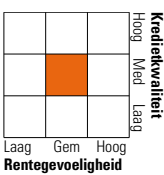
### Kwartaalrendementen

|      | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|------|-------|-------|-------|-------|
| 2020 | -1.10 | 2.57  | 1.86  | 1.94  |
| 2019 | 2.52  | 4.04  | 5.00  | -2.70 |
| 2018 | 1.93  | -0.47 | -1.16 | 0.66  |
| 2017 | -     | -     | 1.17  | 1.56  |

### Portefeuille 31 mrt 2024

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto |
|----------------|--------|---------|---------|
| Aandelen       | 0.00   | 0.00    | 0.00    |
| Obligaties     | 113.92 | 29.89   | 84.02   |
| Kas/ geldmarkt | 26.76  | 10.79   | 15.98   |
| Overig         | 0.00   | 0.00    | 0.00    |

### Morningstar Vastrentende Style Box™



|                     |      |
|---------------------|------|
| Tijdsduur           | -    |
| Effectieve Looptijd | 9.25 |
| Gem Krediet         | A    |
| Kwaliteit           |      |

| Kredietkwaliteit | % Oblg |             | % Oblg |
|------------------|--------|-------------|--------|
| AAA              | 13.62  | BBB         | 36.10  |
| AA               | 32.24  | BB          | 0.00   |
| A                | 18.05  | B           | 0.00   |
|                  |        | Below B     | 0.00   |
|                  |        | Geen Rating | 0.00   |

Data per 31 dec 2023

### Top 10 Onderliggende posities

|                                          | % Port |
|------------------------------------------|--------|
| Euro Bobl Future June 242024-06-06       | 6.92   |
| Ultra 10 Year US Treasury Note Future... | 6.76   |
| Euro Schatz Future June 242024-06-06     | 6.25   |
| France (Republic Of) 3%2033-05-25        | 5.71   |
| Long-Term Euro BTP Future June...        | 4.51   |
| Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31          | 3.87   |
| Italy (Republic Of) 1.45%2025-05-15      | 3.84   |
| Spain (Kingdom of) 3.8%2024-04-30        | 3.71   |
| Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30        | 3.53   |
| Italy (Republic Of) 2%2028-02-01         | 2.97   |
| Totaal Aantal Aandelen                   | 0      |
| Totaal Aantal Obligaties                 | 114    |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities        | 48.08  |

### Maturity-verdeling

|                  | % Oblg |
|------------------|--------|
| 1 tot 3 jaar     | 14.49  |
| 3 tot 5 jaar     | 11.17  |
| 5 tot 7 jaar     | 5.02   |
| 7 tot 10 jaar    | 25.40  |
| 10 tot 15 jaar   | 5.59   |
| 15 tot 20 jaar   | 4.65   |
| 20 tot 30 jaar   | 10.04  |
| Meer dan 30 jaar | 2.19   |

### Couponverdeling

|              | % Oblg |
|--------------|--------|
| 0% PIK       | 8.27   |
| 0% tot 4%    | 82.91  |
| 4% tot 6%    | 7.59   |
| 6% tot 8%    | 1.23   |
| 8% tot 10%   | 0.00   |
| 10% tot 12%  | 0.00   |
| Meer dan 12% | 0.00   |

### Fonds informatie

|                     |                             |                |              |                    |         |
|---------------------|-----------------------------|----------------|--------------|--------------------|---------|
| Fondsgroep          | BlueBay Funds Management... | Vestigingsland | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag | 500,000 |
| Telefoon            | -                           | Fondsvaluta    | EUR          | Min Additioneel    | -       |
| Website             | www.bluebayinvest.com       | UCITS          | ja           |                    |         |
| Oprichtingsdatum    | 14 jun 2017                 | Inc/Acc        | Inc          |                    |         |
| Fondsmanager        | Kaspar Hense                | ISIN           | LU1586343763 |                    |         |
| Aanvangsdatum       | 31 dec 2018                 |                |              |                    |         |
| Koers (25 mrt 2021) | EUR 111.48                  |                |              |                    |         |
| Fondsvermogen (mln) | -                           |                |              |                    |         |

\*To view the complete Morningstar Analyst Rating™ Research Report for this fund, please [Click here to read a detailed report on this fund.](#)

© 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.