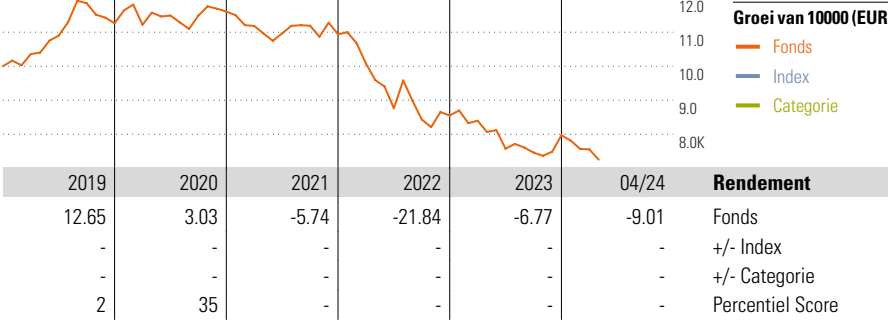


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund S - JPY

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			
Alpha	- Sharpe Ratio	-1.10	
Beta	- Std Deviatie	12.91	
R-kwadraat	- 3-jr Risico	-	
Informatie Ratio	- 5-jr Risico	-	
Tracking Error	- 10-jr Risico	-	

Rendementen (15 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-3.99	-	-
6 Maanden	0.23	-	-
1 jaar	-10.69	-	-
3 jr gean.	-12.14	-	-
5 jr gean.	-7.06	-	-

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	-5.25	-	-	-
2023	-1.79	-9.80	-1.48	6.83
2022	-7.83	-13.08	-3.76	1.38
2021	-3.64	-1.94	2.04	-2.24
2020	-0.41	2.41	-0.02	1.03

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		
Laag Gem Hoog Rentegevoeligheid			

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

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	JPY	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	3 aug 2018	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU1851318409		
Aanvangsdatum	1 dec 2016				
Koers (15 mei 2024)	JPY 9,715.71				
Fondsvermogen (mln)	-				