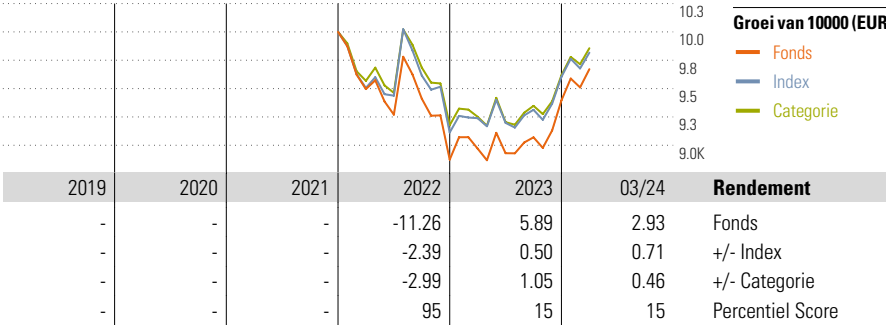


BlueBay Funds - BlueBay Global Investment Grade Corporate Bond Fund R - USD

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index Morningstar Global Corporate Bond GR Hedged USD Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg Gbl Agg Corp 0901 TR Hdg USD	Morningstar Rating™ —	Morningstar Categorie™
---	---	--	---------------------------------	-------------------------------

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporates Bond Index USD Hedged, by investing in a portfolio of investment graded 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...



Risicomaatstaven			Rendementen (25 apr 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	- Sharpe Ratio	-	3 Maanden	0.00	-0.61	-0.85	2024	2.93	-	-	-
Beta	- Std Deviatie	-	6 Maanden	6.63	1.51	1.07	2023	1.09	-0.45	1.57	3.59
R-kwadraat	- 3-jr Risico	-	1 jaar	6.67	0.23	-0.28	2022	-5.04	-2.37	1.52	-5.71
Informatie Ratio	- 5-jr Risico	-	3 jr gean.	-	-	-					
Tracking Error	- 10-jr Risico	-	5 jr gean.	-	-	-					
Berekeningen met Morningstar Gbl Corp Bd GR Hdg USD (waar van toepassing)											

Portefeuille 31 mrt 2024			Morningstar Vastrentende Style Box™		Kredietkwaliteit	% Oblig	% Oblig
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto				
Aandelen	0.00	0.00	0.00		Tijdsduur	-	
Obligaties	137.32	63.90	73.43		Effectieve looptijd	7.31	AAA 0.06 BBB 61.13
Kas/ geldmarkt	44.16	18.81	25.35		Gem Krediet	BBB	AA 2.44 BB 10.79
Overig	1.22	0.00	1.22		Kwaliteit	A	25.55 B 0.00
							Below B 0.00
							Geen Rating 0.03

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblig	Couponverdeling	% Oblig
2 Year Treasury Note Future June...	20.33	1 tot 3 jaar	4.26	0% PIK	0.05
5 Year Treasury Note Future June...	7.34	3 tot 5 jaar	8.46	0% tot 4%	21.59
Euro Schatz Future June 242024-06-06	5.74	5 tot 7 jaar	7.82	4% tot 6%	44.99
US Treasury Bond Future June 242024-06-18	3.76	7 tot 10 jaar	19.52	6% tot 8%	29.24
Ultra US Treasury Bond Future June...	2.47	10 tot 15 jaar	15.54	8% tot 10%	4.14
10 Year Government of Canada Bond...	1.77	15 tot 20 jaar	2.94	10% tot 12%	0.00
Var Energi ASA 8%2032-11-15	1.09	20 tot 30 jaar	3.92	Meer dan 12%	0.00
Broadcom Inc 4.926%2037-05-15	1.04	Meer dan 30 jaar	4.66		
Foundry JV Holdco LLC. 5.875%2034-01-25	1.02				
Bayer US Finance LLC 6.375%2030-11-21	1.01				
Totaal Aantal Aandelen	0				
Totaal Aantal Obligaties	241				
% Van vermogen in top 10 posities	45.58				

Fondsinformatie					
Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	0.75%
Oprichtingsdatum	18 jun 2014	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Andrzej Skiba	ISIN	LU0847091310		
Aanvangsdatum	22 okt 2012				
Koers (25 apr 2024)	USD 89.97				
Fondsvermogen (mln)	USD 1993.81				