

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

Morningstar Medalist Rating™



Indice de la Catégorie

Morningstar Eurozone Core Bond
GR EUR

Utilisé tout au long du rapport

Benchmark du fonds

Bloomberg Euro Agg Bond TR
EUR

Morningstar Rating™

★★★★

Catégorie Morningstar™

Obligations EUR Diversifiées

Objectif d'investissement

Le fonds vise à vous assurer un rendement grâce à un mélange de stratégies : génération de revenus et croissance du montant investi. Il investit principalement dans des obligations qui versent un intérêt fixe. Le fonds vise des rendements meilleurs que ceux de son indice de référence, l'indice Barclays Capital Euro Aggregate Bond Index. Il peut investir des montants substantiels dans d'autres indices si nous estimons que les conditions du marché le justifient. Au moins les deux tiers des investissements du fonds...

Mesures de risque

Alpha	0.64	Ratio de Sharpe	-0.70
Bêta	0.98	Volatilité	7.39
R ²	90.95	Risque 3 ans	> Moy
Ratio	0.32	Risque 5 ans	> Moy
d'information		Risque 10 ans	> Moy
Tracking Error	2.18		

Les calculs utilisent Morningstar EZN Core Bd GR EUR (partout où cela est possible)



	2019	2020	2021	2022	2023	04/24	Performance
Fonds	9.18	6.36	-2.92	-15.78	6.72	-0.36	Fonds
Indice	3.16	2.22	0.03	1.50	-0.09	1.35	+/- Indice
Catégorie	4.81	4.51	-1.31	-3.08	0.50	0.53	+/- Catégorie
Rang %	4	3	77	68	41	30	Rang %

Performances au

(16 mai 2024)

	Fonds	+/-Ind	+/-Cat
3 mois	1.28	0.78	0.46
6 mois	4.86	1.64	1.36
1 an	6.02	2.14	1.59
3 ans (annualisée)	-3.37	0.85	-0.40
5 ans (annualisée)	-0.25	1.64	1.04

Performances

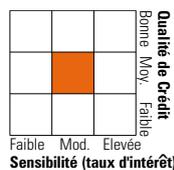
trimestrielles (%)

	Trim 1	Trim 2	Trim 3	Trim 4
2024	0.48	-	-	-
2023	1.50	-0.80	-0.41	6.43
2022	-5.04	-8.63	-3.86	0.97
2021	-1.08	-0.76	0.07	-1.17
2020	-3.25	4.67	1.99	2.99

Portefeuille 31 mars 2024

Allocation d'actifs	% Long	% Court	% Net
Actions	0.00	0.00	0.00
Obligations	122.11	67.26	54.85
Liquidités	60.48	16.07	44.41
Autres	0.74	0.00	0.74

Morningstar Style Box® Obligations



Duration effective	-
Période de maturité	8.90
Qualité de crédit moyenne	BBB

Qualité de

Crédit	Oblig. %	BBB	Oblig. %
AAA	14.00	BBB	39.95
AA	15.22	BB	6.66
A	24.17	B	0.00
		Inférieur à B	0.00
		Non noté	0.00

Données au 31 déc. 2023

10 premières lignes du portefeuille

	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
Nombre de lignes actions	0
Nombre de lignes obligations	225
Poids des 10 premières lignes (%)	42.11

Fourchette de maturité

	Oblig. %
1 à 3	7.30
3 à 5	10.84
5 à 7	12.93
7 à 10	19.95
10 à 15	10.08
15 à 20	7.09
20 à 30	8.00
Supérieure à 30	2.41

Fourchette de rendements

	Oblig. %
0	8.55
0 à 4	60.23
4 à 6	24.77
6 à 8	5.60
8 à 10	0.85
10 à 12	0.00
supérieur à 12	0.00

Opérations

Société de gestion	BlueBay Funds Management...	Domicile	Luxembourg	Investissement initial minimum	100,000
Téléphone	-	Devise	EUR	Investissement suivant minimum	-
Site Internet	www.bluebayinvest.com	UCITS	oui	Commission de gestion annuelle	0.50%
Date de création	6 janv. 2014	Dis/Cap	Capi.	actuelle	
Gérant	Kaspar Hense	ISIN	LU0549542800		
Gère le fonds depuis	1 déc. 2016				
Valeur liquidative (16 mai 2024)	126.30 EUR				

Actif net (millions)

2378.13 EUR