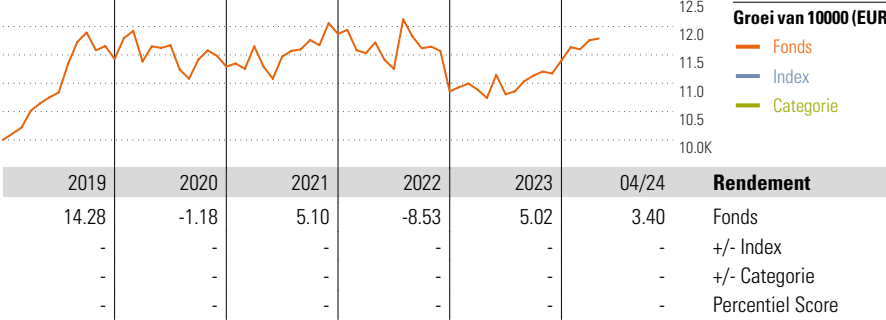


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund R - USD

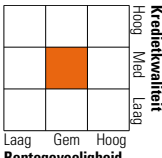
Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR	—	Obligaties Overig

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 (16 mei 2024)				Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen			
Alpha	-	Sharpe Ratio	0.06	3 Maanden			0.68	-	-	2024	1e kw	2e kw	3e kw
Beta	-	Std Deviatie	8.34	6 Maanden			5.64	-	-	2023	0.27	-0.75	3.06
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar			7.64	-	-	2022	-2.83	-2.41	3.22
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gean.			1.79	-	-	2021	3.16	-1.53	2.53
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gean.			1.89	-	-	2020	-0.39	2.51	-2.17
											4e kw	-1.08	

Portefeuille 31 mrt 2024											
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™				Kredietkwalite		% Oblg	% Oblg
Aandelen	0.00	0.00	0.00		Kredietkwaliteit	Tijdsduur	-	it			
Obligaties	122.11	67.26	54.85			Effectieve looptijd	8.90	AAA	14.00	BBB	39.95
Kas/ geldmarkt	60.48	16.07	44.41			Gem Krediet	BBB	AA	15.22	BB	6.66
Overig	0.74	0.00	0.74			Kwaliteit		A	24.17	B	0.00
				Laag	Gem	Hoog				Below B	0.00
				Rentegevoeligheid						Geen Rating	0.00

Top 10 Onderliggende posities	% Port	Maturity-verdeling	% Oblg	Couponverdeling	% Oblg
Euro Schatz Future June 242024-06-06	15.17	1 tot 3 jaar	7.30	0% PIK	8.55
Ultra 10 Year US Treasury Note Future...	6.67	3 tot 5 jaar	10.84	0% tot 4%	60.23
France (Republic Of) 2.5%2030-05-25	4.34	5 tot 7 jaar	12.93	4% tot 6%	24.77
Spain (Kingdom of) 0%2027-01-31	3.18	7 tot 10 jaar	19.95	6% tot 8%	5.60
Spain (Kingdom of) 0.7%2032-04-30	2.37	10 tot 15 jaar	10.08	8% tot 10%	0.85
		15 tot 20 jaar	7.09	10% tot 12%	0.00
Spain (Kingdom of) 3.25%2034-04-30	2.23	20 tot 30 jaar	8.00	Meer dan 12%	0.00
Mexico (United Mexican States)...	2.21	Meer dan 30 jaar	2.41		
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				

Fondsinformatie			
Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg
Telefoon	-	Fondsvaluta	USD
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja
Oprichtingsdatum	28 mei 2012	Inc/Acc	Acc
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU0549543873
Aanvangsdatum	1 dec 2016		
Koers (16 mei 2024)	USD 172.78		
Fondsvermogen (mln)	EUR 2378.13		
		Min Aanvangsbedrag	-
		Min Additioneel	-
		Jaarlijkse Management Fee	0.75%