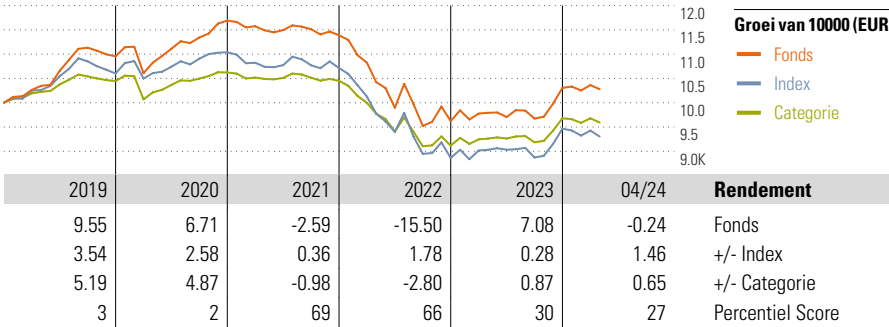


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund S - EUR

Morningstar Medalist Rating™ 	Morningstar Categorie Index Morningstar Eurozone Core Bond GR EUR Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds Bloomberg Euro Agg Bond TR EUR	Morningstar Rating™ ★★★★	Morningstar Categorie™ Obligaties Euro Gediversifieerd
--	--	---	------------------------------------	--

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	0.98	Sharpe Ratio	-0.66
Beta	0.98	Std Deviatie	7.39
R-kwadraat	90.93	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	0.47	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	2.19	10-jr Risico	Bov gem

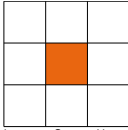
Berekeningen met Morningstar EZN Core Bd GR EUR (waar van toepassing)

Rendementen (16 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	1.37	0.86	0.55
6 Maanden	5.04	1.82	1.54
1 jaar	6.38	2.50	1.95
3 jr gean.	-3.04	1.18	-0.07
5 jr gean.	0.09	1.98	1.37

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	0.57	-	-	-
2023	1.59	-0.71	-0.33	6.52
2022	-4.96	-8.56	-3.78	1.06
2021	-1.00	-0.68	0.16	-1.09
2020	-3.18	4.76	2.07	3.07

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	

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

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

Data per 31 dec 2023

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	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	0.25%
Oprichtingsdatum	5 dec 2013	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU0995160461		
Aanvangsdatum	1 dec 2016				
Koers (16 mei 2024)	EUR 132.59				
Fondsvermogen (mln)	EUR 2378.13				