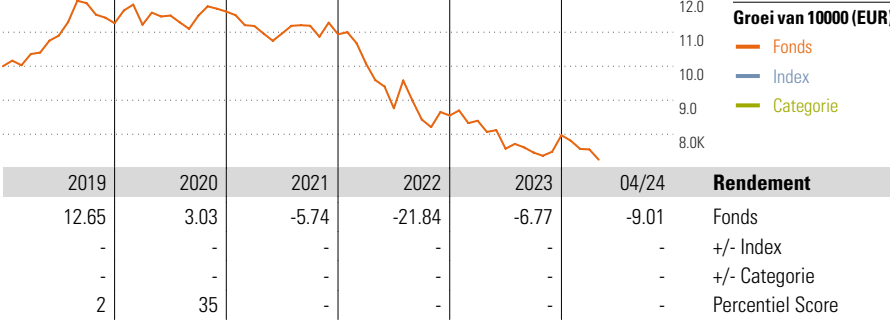


BlueBay Funds - BlueBay Investment Grade Euro Aggregate Bond Fund S - JPY

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			Rendementen (16 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Alpha	-	Sharpe Ratio	-1.10	3 Maanden	-3.86	-	2024	-5.25	-	-	-
Beta	-	Std Deviatie	12.91	6 Maanden	-0.46	-	2023	-1.79	-9.80	-1.48	6.83
R-kwadraat	-	3-jr Risico	-	1 jaar	-10.44	-	2022	-7.83	-13.08	-3.76	1.38
Informatie Ratio	-	5-jr Risico	-	3 jr gean.	-12.21	-	2021	-3.64	-1.94	2.04	-2.24
Tracking Error	-	10-jr Risico	-	5 jr gean.	-7.13	-	2020	-0.41	2.41	-0.02	1.03

Portefeuille	31 mrt 2024										
Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto	Morningstar Vastrentende Style Box™	Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg				
Aandelen	0.00	0.00	0.00	Tijdsduur	-	AAA	14.00	BBB	39.95		
Obligaties	122.11	67.26	54.85	Effectieve looptijd	8.90	AA	15.22	BB	6.66		
Kas/ geldmarkt	60.48	16.07	44.41	Gem Krediet	BBB	A	24.17	B	0.00		
Overig	0.74	0.00	0.74	Kwaliteit				Below B	0.00		
								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
Spain (Kingdom of) 3.25%2034-04-30	2.23	15 tot 20 jaar	7.09	10% tot 12%	0.00
Mexico (United Mexican States)...	2.21	20 tot 30 jaar	8.00	Meer dan 12%	0.00
Euro Bobl Future June 242024-06-06	2.06	Meer dan 30 jaar	2.41		
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	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	JPY	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	0.25%
Oprichtingsdatum	3 aug 2018	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Kaspar Hense	ISIN	LU1851318409		
Aanvangsdatum	1 dec 2016				
Koers (16 mei 2024)	JPY 9,704.76				
Fondsvermogen (mln)	EUR 2378.13				