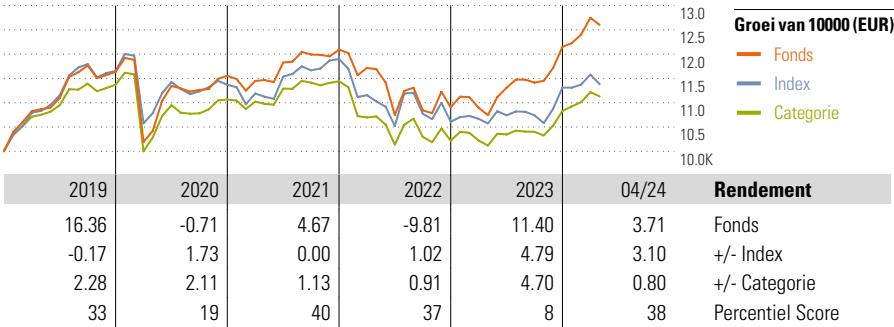


BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Bond Fund Q - USD

Morningstar Medalist Rating™ 	Morningstar Categorie Index Morningstar Emerging Markets Sovereign Bond GR USD Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds JPM EMBI Global Diversified TR USD	Morningstar Rating™ ★★★★	Morningstar Categorie™ Obligaties Wereldwijd Emerging Markets
--	---	---	------------------------------------	--

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the JP Morgan Emerging Market Bond Index Global Diversified, by investing in a portfolio of fixed income securities of issuers based in Emerging Market Countries 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...



Risicomaatstaven			
Alpha	2.40	Sharpe Ratio	0.27
Beta	0.99	Std Deviatie	8.12
R-kwadraat	90.14	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	0.66	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	3.53	10-jr Risico	-

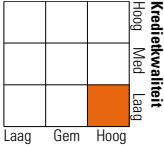
Berekeningen met Morningstar EM Sov Bd GR USD (waar van toepassing)

Rendementen (24 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	2.36	1.11	0.45
6 Maanden	9.46	2.76	1.64
1 jaar	15.52	8.33	5.00
3 jr gean.	3.52	2.43	1.87
5 jr gean.	3.05	2.00	1.66

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	4.92	-	-	-
2023	-0.10	3.78	0.95	6.44
2022	-3.12	-8.28	0.90	0.60
2021	-0.91	3.31	1.39	0.85
2020	-12.43	11.33	-0.71	2.57

Portefeuille 30 apr 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.00	0.00
Obligaties	95.80	26.36	69.44
Kas/ geldmarkt	35.04	4.48	30.56
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™		
	Tijdsduur	-
	Effectieve Looptijd	14.21
	Gem Krediet	BB
	Kwaliteit	

Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg
AAA	0.00	BBB 16.74
AA	16.79	BB 32.32
A	5.18	B 17.10
		Below B 11.88
		Geen Rating 0.00

Top 10 Onderliggende posities	% Port
2 Year Treasury Note Future June...	5.56
Oman (Sultanate Of) 6.75%2048-01-17	2.51
Petroleos Mexicanos 5.625%2046-01-23	2.02
Petroleos Mexicanos 6.35%2048-02-12	1.76
Turkey (Republic of) 4.875%2043-04-16	1.75
Mexico (United Mexican States)...	1.49
Petroleos de Venezuela SA 0%2099-10-27	1.41
Turkey (Republic of) 5.75%2047-05-11	1.34
Saudi Arabia (Kingdom of) 5.75%2054-01-16	1.31
Argentina (Republic of) 3.5%2041-07-09	1.29
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	176
% Van Vermogen In Top 10 Posities	20.45

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	5.17
3 tot 5 jaar	11.46
5 tot 7 jaar	6.47
7 tot 10 jaar	13.25
10 tot 15 jaar	8.91
15 tot 20 jaar	8.48
20 tot 30 jaar	26.75
Meer dan 30 jaar	10.49

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	1.20
0% tot 4%	21.18
4% tot 6%	35.26
6% tot 8%	33.41
8% tot 10%	7.67
10% tot 12%	0.99
Meer dan 12%	0.28

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	6 jun 2017	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Polina Kurdyavko	ISIN	LU1170318619		
Aanvangsdatum	1 dec 2017				
Koers (24 mei 2024)	USD 118.74				
Fondsvermogen (mln)	-				