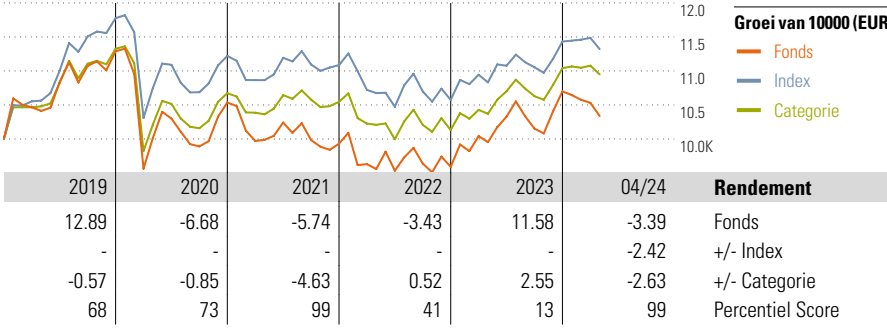


BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund R - USD (AIDiv)

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index Morningstar Emerging Markets Government Bond Local Currency GR USD Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds JPM GBI-EM Global Diversified TR USD	Morningstar Rating™ ★★	Morningstar Categorie™ Obligaties Wereldwijd Emerging Markets Lokale Valuta
---	---	--	----------------------------------	---

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the JP Morgan Government Bond Index – Emerging Markets Global Diversified (GBI-EM Global Diversified), USD unhedged, by investing in a portfolio of fixed income government securities of issuers based in Emerging Market Countries and mainly denominated in Local Currencies. 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,...



Risicomaatstaven			
Alpha	0.85	Sharpe Ratio	0.01
Beta	1.17	Std Deviatie	6.91
R-kwadraat	92.86	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	-0.06	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	3.51	10-jr Risico	Bov gem

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

Rendementen (16 mei 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
3 Maanden	-0.59	-0.34	-0.87	2024	-1.58	-	-	-
6 Maanden	1.65	-1.12	-1.50	2023	4.73	2.85	-1.71	5.39
1 jaar	3.87	0.55	-1.72	2022	-3.02	-1.01	1.11	-0.51
3 jr gean.	1.71	0.12	-0.68	2021	-5.36	2.72	-2.52	-0.54
5 jr gean.	0.28	-1.38	-1.23	2020	-15.29	7.69	-3.97	6.52

Portefeuille 29 feb 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.00	0.01	-0.01
Obligaties	102.74	16.24	86.50
Kas/ geldmarkt	254.21	240.70	13.50
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Vastrentende Style Box™			
	Laag	Gem	Hoog
	Rentegevoeligheid		
	Kredietkwaliteit		
	Tijdsduur		
			-
			8.89
			BBB
			Kwaliteit

Kredietkwaliteit	% Oblg		% Oblg
AAA	0.00	BBB	51.50
AA	4.34	BB	21.04
A	21.73	B	1.38
		Below B	0.00
		Geen Rating	0.00

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities	% Port
China (People's Republic Of)...	9.86
Indonesia (Republic of) 7%2033-02-15	4.43
Thailand (Kingdom Of) 3.65%2031-06-20	4.19
South Africa (Republic of) 8.5%2037-01-31	4.12
South Africa (Republic of) 8.25%2032-03-31	3.59
Czech (Republic of) 2%2033-10-13	3.53
Indonesia (Republic of) 8.375%2034-03-15	3.25
Poland (Republic of) 1.75%2032-04-25	3.08
Indonesia (Republic of) 7.125%2038-06-15	3.05
Peru (Republic of) 7.3%2033-08-12	3.01
Totaal Aantal Aandelen	0
Totaal Aantal Obligaties	58
% Van Vermogen In Top 10 Posities	42.11

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	9.58
3 tot 5 jaar	9.49
5 tot 7 jaar	18.32
7 tot 10 jaar	32.70
10 tot 15 jaar	20.26
15 tot 20 jaar	6.15
20 tot 30 jaar	2.23
Meer dan 30 jaar	0.00

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	0.26
0% tot 4%	31.90
4% tot 6%	7.64
6% tot 8%	23.42
8% tot 10%	31.94
10% tot 12%	0.68
Meer dan 12%	4.16

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	23 mrt 2010	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Brent David	ISIN	LU0357315554		
Aanvangsdatum	1 jul 2014				
Koers (16 mei 2024)	USD 37.23				
Fondsvermogen (mln)	USD 7.58				