

BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market High Yield Corporate Bond Fund R - EUR (AIDiv)

Morningstar Categorie Index

JPM CEMBI Broad Diversified Hedged TR EUR

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

JPM CEMBI Diversified HY TR USD

Morningstar Rating™

—

Morningstar Categorie™

Obligaties Wereldwijd Emerging Markets Bedrijven - EUR Gericht

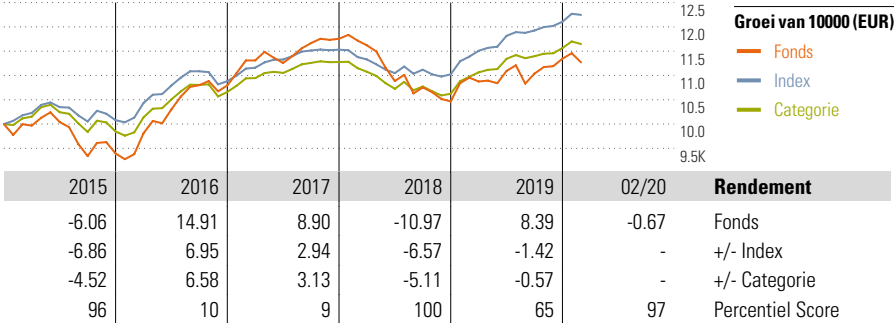
Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed and targets better returns than its benchmark, the JP Morgan Corporate Emerging Market Diversified High Yield Index 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 to companies, countries or sectors not...

Risicomaatstaven

Alpha	-5.19	Sharpe Ratio	0.09
Beta	1.55	Std Deviatie	5.50
R-kwadraat	64.89	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	-0.92	5-jr Risico	-
Tracking Error	3.62	10-jr Risico	-

Berekeningen met JPM CEMBI Broad Diversified Hdg TR EUR (waar van toepassing)



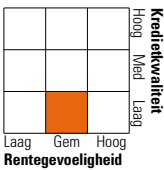
Rendementen (19 mrt 2020)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-20.62	-21.47	-21.18
6 Maanden	-18.47	-25.77	-25.96
1 jaar	-18.28	-23.60	-22.99
3 jr gean.	-6.97	-4.43	-3.16
5 jr gean.	-1.78	-2.14	-1.33

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2019	3.91	2.01	-0.50	2.78
2018	-1.15	-6.32	-1.20	-2.68
2017	4.77	-0.45	3.63	0.76
2016	4.45	5.02	4.82	-0.06
2015	-0.32	0.73	-6.97	0.56

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.53	0.00	0.53
Obligaties	101.56	13.73	87.83
Kas/ geldmarkt	13.06	1.42	11.64
Overig	0.01	0.00	0.01

Morningstar Vastrentende Style Box™



Tijdsduur	-
Effectieve Looptijd	5.27
Gem Krediet	B
Kwaliteit	

Kredietkwaliteit	% Oblg	% Oblg
AAA	0.00	BBB 2.37
AA	0.00	BB 48.31
A	0.00	B 38.88
		Below B 10.44
		Geen Rating 0.00

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities	% Port
2 Year Treasury Note Future June...	5.89
Samarco Mineracao SA 9.5%2031-06-30	3.12
Petroleos Mexicanos 6.95%2060-01-28	2.06
Standard Chartered PLC 7.875%2030-03-08	1.78
Oryx Funding Ltd. 5.8%2031-02-03	1.74
Digicel Intermediate Holdings Ltd /...	1.68
Avianca Midco 2 Ltd. 9%2028-12-01	1.67
Ecopetrol S.A. 8.875%2033-01-13	1.66
Leviathan Bond Limited 6.5%2027-06-30	1.47
Kosmos Energy Ltd 7.5%2028-03-01	1.40
Totaal Aantal Aandelen	4
Totaal Aantal Obligaties	135
% Van Vermogen In Top 10 Posities	22.47

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	20.40
3 tot 5 jaar	28.18
5 tot 7 jaar	16.35
7 tot 10 jaar	15.20
10 tot 15 jaar	4.88
15 tot 20 jaar	0.57
20 tot 30 jaar	1.26
Meer dan 30 jaar	3.64

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	0.78
0% tot 4%	5.02
4% tot 6%	24.95
6% tot 8%	34.86
8% tot 10%	30.75
10% tot 12%	0.87
Meer dan 12%	2.78

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	15 okt 2012	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Polina Kurdyavko	ISIN	LU0720472819		
Aanvangsdatum	17 jan 2012				
Koers (19 mrt 2020)	EUR 49.85				
Fondsvermogen (mln)	EUR 0.17				