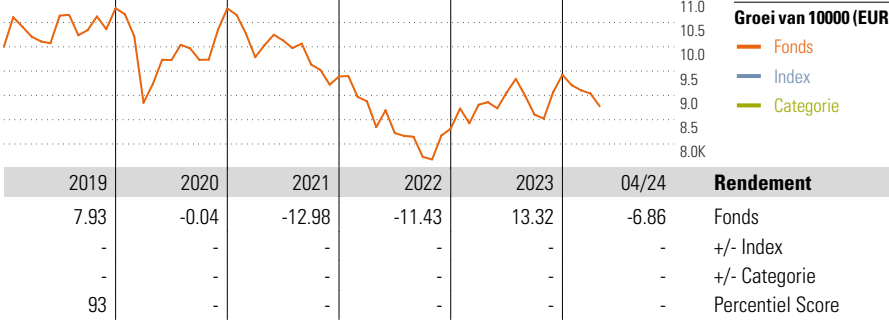


BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Local Currency Bond Fund M - EUR

Morningstar Categorie Index	Benchmark van het fonds	Morningstar Rating™	Morningstar Categorie™
—	JPM GBI-EM Global Diversified TR USD	—	Obligaties Overig

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			Rendementen (16 mei 2024)				Kwartaalrendementen			
Alpha	- Sharpe Ratio	-0.44	3 Maanden	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
Beta	- Std Deviatie	11.73	6 Maanden	0.05	-	-	2024	-4.07	-	-
R-kwadraat	- 3-jr Risico	-	1 jaar	0.92	-	-	2023	5.92	2.84	-5.01
Informatie Ratio	- 5-jr Risico	-	3 jr gean.	2.34	-	-	2022	-5.43	-7.37	-5.96
Tracking Error	- 10-jr Risico	-	5 jr gean.	-3.59	-	-	2021	-9.29	3.50	-4.88
				-1.99	-	-	2020	-18.00	9.90	0.05
									10.87	

Portefeuille 29 feb 2024												
Assetverdeling				Morningstar Vastrentende Style Box™				Kredietkwalite				
	% Long	% Short	% Netto	Kredietkwaliteit			Tijdsduur	-	% Oblg	% Oblg		
Aandelen	0.00	0.01	-0.01				Effectieve Looptijd	8.89	AAA	0.00	BBB	51.50
Obligaties	102.74	16.24	86.50				Gem Krediet	BBB	AA	4.34	BB	21.04
Kas/ geldmarkt	254.21	240.70	13.50				Kwaliteit		A	21.73	B	1.38
Overig	0.00	0.00	0.00	Laag Gem Hoog Rentegevoeligheid					Below B	0.00		
									Geen Rating	0.00		

Top 10 Onderliggende posities		% Port	Maturity-verdeling		% Oblg	Couponverdeling		% Oblg
China (People's Republic Of)...		9.86	1 tot 3 jaar		9.58	0% PIK		0.26
Indonesia (Republic of) 7%2033-02-15		4.43	3 tot 5 jaar		9.49	0% tot 4%		31.90
Thailand (Kingdom Of) 3.65%2031-06-20		4.19	5 tot 7 jaar		18.32	4% tot 6%		7.64
South Africa (Republic of) 8.5%2037-01-31		4.12	7 tot 10 jaar		32.70	6% tot 8%		23.42
South Africa (Republic of) 8.25%2032-03-31		3.59	10 tot 15 jaar		20.26	8% tot 10%		31.94
Czech (Republic of) 2%2033-10-13		3.53	15 tot 20 jaar		6.15	10% tot 12%		0.68
Indonesia (Republic of) 8.375%2034-03-15		3.25	20 tot 30 jaar		2.23	Meer dan 12%		4.16
Poland (Republic of) 1.75%2032-04-25		3.08	Meer dan 30 jaar		0.00			
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						

Fondsinformatie					
Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	2 feb 2016	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Brent David	ISIN	LU0720462695		
Aanvangsdatum	1 jul 2014				
Koers (16 mei 2024)	EUR 92.33				
Fondsvermogen (mln)	-				