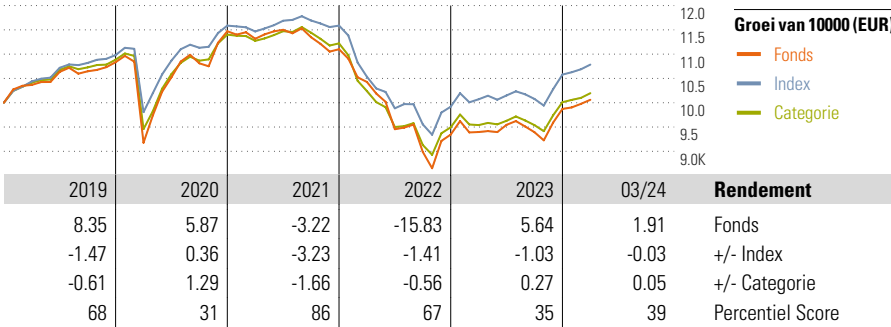


BlueBay Funds - BlueBay Emerging Market Corporate Bond Fund B - EUR

Morningstar Medalist Rating™ Neutral	Morningstar Categorie Index JPM CEMBI Broad Diversified Hedged TR EUR Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds JPM CEMBI Diversified 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 Bond Index (CEMBI) Diversified, by investing in a portfolio of fixed income securities of corporate 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...



Risicomaatstaven			
Alpha	-1.34	Sharpe Ratio	-0.58
Beta	1.14	Std Deviatie	8.36
R-kwadraat	88.66	3-jr Risico	Bov gem
Informatie Ratio	-0.62	5-jr Risico	Bov gem
Tracking Error	2.92	10-jr Risico	Bov gem
Berekeningen met JPM CEMBI Broad Diversified Hdj TR EUR (waar van toepassing)			

Rendementen (25 apr 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.95	0.10	0.39
6 Maanden	7.86	0.55	0.36
1 jaar	5.29	-0.03	0.58
3 jr gean.	-4.46	-1.93	-0.66
5 jr gean.	-0.93	-1.28	-0.48

Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	1.91	-	-	-
2023	0.57	1.57	-1.59	5.09
2022	-6.08	-9.32	-4.94	3.97
2021	-1.35	1.63	-1.33	-2.17
2020	-15.30	14.68	2.72	6.11

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	0.20	0.00	0.20
Obligaties	105.50	30.46	75.05
Kas/ geldmarkt	26.04	1.31	24.73
Overig	0.02	0.00	0.02

Morningstar Vastrentende Style Box™			
	Tijdsduur	-	
	Effectieve Looptijd	6.03	
	Gem Krediet	BB	
	Kwaliteit		
Laag Gem Hoog			Hoog Mied Laag
Rentegevoeligheid			

Kredietkwalite it	% Oblg	% Oblg
AAA	0.00	BBB 30.89
AA	7.09	BB 29.83
A	11.10	B 16.41
		Below B 4.68
		Geen Rating 0.00

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities	% Port
2 Year Treasury Note Future June...	11.05
United States Treasury Notes...	1.97
Samarco Mineracao SA 9.5%2031-06-30	1.93
Galaxy Pipeline Assets Bidco Ltd....	1.47
Mizrahi Tefahot Bank Limited...	1.39
Korea Electric Power Corp....	1.39
Saudi Electricity Sukuk Programme Co....	1.27
First Abu Dhabi Bank P.J.S.C...	1.26
Banco de Credito del Peru 3.125%2025-07-0	1.25
EIG Pearl Holdings S.a.r.l....	1.18
Totaal Aantal Aandelen	4
Totaal Aantal Obligaties	224
% Van Vermogen In Top 10 Posities	24.15

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	16.67
3 tot 5 jaar	21.30
5 tot 7 jaar	14.47
7 tot 10 jaar	17.55
10 tot 15 jaar	6.26
15 tot 20 jaar	2.03
20 tot 30 jaar	8.46
Meer dan 30 jaar	1.34

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	0.51
0% tot 4%	22.62
4% tot 6%	36.34
6% tot 8%	21.26
8% tot 10%	18.44
10% tot 12%	0.00
Meer dan 12%	0.84

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	100,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	EUR	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	25 mei 2009	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Polina Kurdyavko	ISIN	LU0356217843		
Aanvangsdatum	31 mrt 2008				
Koers (25 apr 2024)	EUR 167.37				
Fondsvermogen (mln)	EUR 2.85				