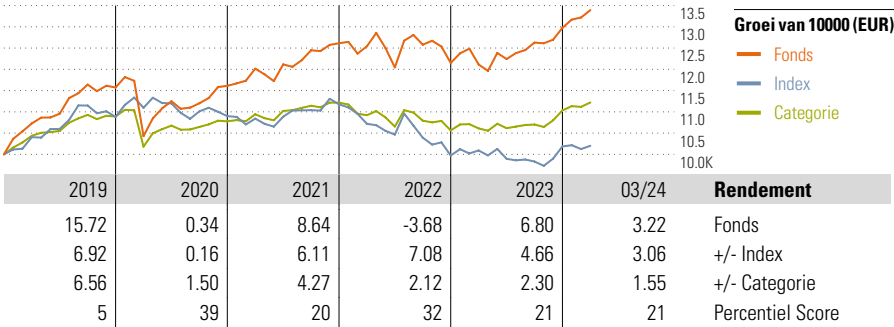


BlueBay Funds - BlueBay Total Return Credit Fund C - USD (QID)

Morningstar Medalist Rating™ 	Morningstar Categorie Index Bloomberg Global Aggregate TR USD Wordt gebruikt in dit rapport als index	Benchmark van het fonds No benchmark	Morningstar Rating™ —	Morningstar Categorie™ Global Flexible Bond
--	--	--	---------------------------------	---

Beleggingsdoelstelling

The Sub-Fund is actively managed, does not reference any benchmark and aims to achieve a total return from investments in higher yielding fixed income asset classes through active security selection, asset allocation and capital preservation techniques while taking into account ESG considerations.



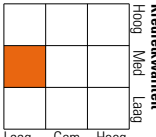
Risicomaatstaven			
Alpha	2.64	Sharpe Ratio	0.39
Beta	0.61	Std Deviatie	6.82
R-kwadraat	57.22	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	0.98	5-jr Risico	-
Tracking Error	5.66	10-jr Risico	-

Berekeningen met Bloomberg Global Aggregate TR USD (waar van toepassing)

Rendementen (26 apr 2024)	Rend %	+/-Idx	+/-Cat	Kwartaalrendementen	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
3 Maanden	1.95	2.55	1.10	2024	3.22	-	-	-
6 Maanden	6.31	3.27	1.65	2023	-0.29	1.06	3.16	2.74
1 jaar	11.99	11.14	6.15	2022	-0.57	-3.96	4.43	-3.41
3 jr gean.	4.22	6.36	2.73	2021	3.48	0.84	2.74	1.34
5 jr gean.	4.22	4.93	3.03	2020	-9.88	7.87	-0.43	3.66

Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	1.17	0.54	0.63
Obligaties	117.19	10.46	106.72
Kas/ geldmarkt	104.66	119.71	-15.05
Overig	7.70	0.00	7.70

Morningstar Vastrentende Style Box™		
	Tijdsduur	-
	Effectieve Looptijd	6.36
	Gem Krediet	BB
	Kwaliteit	

Kredietkwalite it	% Oblg	% Oblg
AAA	2.98	BBB 27.23
AA	6.55	BB 32.20
A	14.56	B 14.03
		Below B 2.42
		Geen Rating 0.03

Data per 31 dec 2023

Top 10 Onderliggende posities	% Port
2 Year Treasury Note Future June...	26.31
5 Year Treasury Note Future June...	5.64
United States Treasury Notes...	2.48
BNP Paribas SA 7.75%2029-08-16	1.95
Intesa Sanpaolo S.p.A. 7.75%2027-01-11	1.12
Caixabank S.A. 5.875%2027-10-09	1.05
HSBC Holdings PLC 4.856%2032-05-23	1.00
Deutsche Bank AG 10%2027-12-01	0.96
ABN AMRO Bank N.V. 4.375%2025-09-22	0.93
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria, S.A....	0.88
Totaal Aantal Aandelen	1
Totaal Aantal Obligaties	347
% Van Vermogen In Top 10 Posities	42.33

Maturity-verdeling	% Oblg
1 tot 3 jaar	9.94
3 tot 5 jaar	17.15
5 tot 7 jaar	12.30
7 tot 10 jaar	12.01
10 tot 15 jaar	11.65
15 tot 20 jaar	2.88
20 tot 30 jaar	2.91
Meer dan 30 jaar	2.32

Couponverdeling	% Oblg
0% PIK	5.41
0% tot 4%	11.55
4% tot 6%	24.33
6% tot 8%	37.37
8% tot 10%	18.98
10% tot 12%	1.98
Meer dan 12%	0.39

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlueBay Funds Management...	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	10,000
Telefoon	-	Fondsvaluta	USD	Min Additioneel	-
Website	www.bluebayinvest.com	UCITS	ja		
Oprichtingsdatum	28 nov 2014	Inc/Acc	Inc		
Fondsmanager	Not Disclosed	ISIN	LU1128624639		
Aanvangsdatum	1 jan 2022				
Koers (26 apr 2024)	USD 83.25				
Fondsvermogen (mln)	USD 28.64				