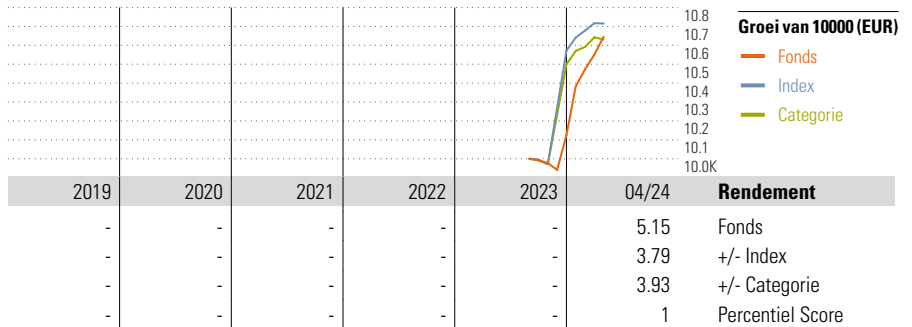


## BlueBay Funds - BlueBay High Yield ESG Bond Fund M USD

|                                                                                                 |                                             |                                       |                            |                               |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------------|---------------------------------------|----------------------------|-------------------------------|
| <b>Morningstar Medalist Rating™</b>                                                             | <b>Morningstar Categorie Index</b>          | <b>Benchmark van het fonds</b>        | <b>Morningstar Rating™</b> | <b>Morningstar Categorie™</b> |
|  <b>Bronze</b> | Morningstar Eurozone High-Yield Bond GR EUR | ICE BofA Euran Ccy HY Constnd TR HEUR | —                          | Obligaties Euro High Yield    |
|                                                                                                 | Wordt gebruikt in dit rapport als index     |                                       |                            |                               |

## Beleggingsdoelstelling

Het fonds streeft naar rendement door enerzijds inkomsten te genereren en anderzijds het door u belegde bedrag te laten groeien. Het belegt voornamelijk in obligaties die een vaste rente betalen.



| Risicomaatstaven |                |   | Rendementen (16 mei 2024) | Rend % | +/-Idx | +/-Cat | Kwartaalrendementen | 1e kw | 2e kw | 3e kw | 4e kw |
|------------------|----------------|---|---------------------------|--------|--------|--------|---------------------|-------|-------|-------|-------|
| Alpha            | - Sharpe Ratio | - | 3 Maanden                 | 0.74   | -0.63  | -0.47  | 2024                | 4.21  | -     | -     | -     |
| Beta             | - Std Deviatie | - | 6 Maanden                 | 7.30   | 0.87   | 1.15   | 2023                | -     | -     | -     | 1.33  |
| R-kwadraat       | - 3-jr Risico  | - | 1 jaar                    | -      | -      | -      |                     |       |       |       |       |
| Informatie Ratio | - 5-jr Risico  | - | 3 jr gean.                | -      | -      | -      |                     |       |       |       |       |
| Tracking Error   | - 10-jr Risico | - | 5 jr gean.                | -      | -      | -      |                     |       |       |       |       |

## Portefeuille 30 apr 2024

| Assetverdeling | % Long | % Short | % Netto | Morningstar Vastrentende Style Box™                                                                                    |                  |                     | Kredietkwalite | % Oblg | % Oblg      |      |       |
|----------------|--------|---------|---------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|------------------|---------------------|----------------|--------|-------------|------|-------|
| Aandelen       | 0.06   | 0.00    | 0.06    | <div><div></div><div></div><div></div><div></div><div></div></div> <div>LaagGemHoog</div> <div>Rentegevoeligheid</div> | Kredietkwaliteit | Tijdsduur           | -              | it     |             |      |       |
| Obligaties     | 88.69  | 0.00    | 88.69   |                                                                                                                        |                  | Effectieve Looptijd | 3.62           | AAA    | 0.00        | BBB  | 6.86  |
| Kas/ geldmarkt | 29.86  | 19.37   | 10.49   |                                                                                                                        |                  | Gem Krediet         | B              | AA     | 0.00        | BB   | 44.00 |
| Overig         | 0.76   | 0.00    | 0.76    |                                                                                                                        |                  | Kwaliteit           |                | A      | 2.83        | B    | 40.78 |
|                |        |         |         |                                                                                                                        |                  |                     |                |        | Below B     | 4.95 |       |
|                |        |         |         |                                                                                                                        |                  |                     |                |        | Geen Rating | 0.58 |       |

| Top 10 Onderliggende posities              | % Port | Maturity-verdeling | % Oblg | Couponverdeling | % Oblg |
|--------------------------------------------|--------|--------------------|--------|-----------------|--------|
| European Union 0%2024-06-07                | 2.89   | 1 tot 3 jaar       | 24.91  | 0% PIK          | 0.12   |
| Cellnex Finance Company S.A.U....          | 1.32   | 3 tot 5 jaar       | 33.05  | 0% tot 4%       | 33.42  |
| Nidda Healthcare Holding GmbH...           | 1.28   | 5 tot 7 jaar       | 23.92  | 4% tot 6%       | 29.02  |
| Heathrow Finance PLC 6.625%2031-03-01      | 1.13   | 7 tot 10 jaar      | 8.59   | 6% tot 8%       | 24.75  |
| Teva Pharmaceutical Finance Netherlands... | 1.11   | 10 tot 15 jaar     | 0.85   | 8% tot 10%      | 9.65   |
|                                            |        | 15 tot 20 jaar     | 0.00   | 10% tot 12%     | 3.04   |
| Telecom Italia S.p.A. 7.875%2028-07-31     | 1.00   | 20 tot 30 jaar     | 1.43   | Meer dan 12%    | 0.00   |
| Pinnacle Bidco PLC 10%2028-10-11           | 0.99   | Meer dan 30 jaar   | 3.19   |                 |        |
| Boxer Parent Company Inc 6.5%2025-10-02    | 0.97   |                    |        |                 |        |
| Abertis Infraestructuras Finance B.V....   | 0.97   |                    |        |                 |        |
| Organon & Co 2.875%2028-04-30              | 0.95   |                    |        |                 |        |
| Totaal Aantal Aandelen                     | 4      |                    |        |                 |        |
| Totaal Aantal Obligaties                   | 217    |                    |        |                 |        |
| % Van Vermogen In Top 10 Posities          | 12.62  |                    |        |                 |        |

## Fondsinformatie

|                     |                             |                |              |                    |   |
|---------------------|-----------------------------|----------------|--------------|--------------------|---|
| Fondsgroep          | BlueBay Funds Management... | Vestigingsland | Luxemburg    | Min Aanvangsbedrag | - |
| Telefoon            | -                           | Fondsvaluta    | USD          | Min Additioneel    | - |
| Website             | www.bluebayinvest.com       | UCITS          | ja           |                    |   |
| Oprichtingsdatum    | 26 sep 2023                 | Inc/Acc        | Acc          |                    |   |
| Fondsmanager        | Justin Jewell               | ISIN           | LU0720461531 |                    |   |
| Aanvangsdatum       | 1 aug 2013                  |                |              |                    |   |
| Koers (16 mei 2024) | USD 108.61                  |                |              |                    |   |
| Fondsvermogen (mln) | -                           |                |              |                    |   |