

Basisinformationsblatt

Zweck

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

Produkt

| | |
|--|---|
| Name: | BlueBay Funds - BlueBay Financial Capital Bond Fund - S - USD |
| Name des PRIIP-Herstellers: | BlueBay Funds Management Company S.A. |
| ISIN: | LU1163205252 |
| Webseite des PRIIP-Herstellers: | www.rbcbluebay.com |
| Telefonnummer: | +352 274 7571 |
| Name der zuständigen Behörde: | Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) |
| Dieses PRIIP ist zugelassen in: | Luxemburg |
| Erstellungsdatum: | 29/02/2024 |

Um welche Art von Produkt handelt es sich?

Art des Produktes

Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen eines OGAW nach luxemburgischem Recht.

Laufzeit

Für dieses Produkt gilt kein Mindestanlagezeitraum, das Produkt ist jedoch für mittel- bis langfristige Anlagen gedacht, und der empfohlene Mindestanlagezeitraum beträgt 5 Jahre. Der empfohlene Mindestanlagezeitraum richtet sich nach dem Risiko-Rendite-Profil des Fonds. Wenn Sie den Fonds vor Ablauf des empfohlenen Mindestanlagezeitraums veräußern, besteht ein höheres Risiko für eine Wertschwankung des Fonds.

Ziele

Der Fonds zielt darauf ab, durch eine Mischung aus Ertragserswirtschaftung und Vermehrung des ursprünglich investierten Betrags eine Rendite zu erreichen. Er investiert hauptsächlich in festverzinsliche oder variable verzinsliche Anleihen, die von Finanzinstituten begeben werden.

Der Fonds wird aktiv verwaltet und orientiert sich nicht an einer Benchmark. Er berücksichtigt ökologische Kriterien, soziale Kriterien und Kriterien der Unternehmensführung (ESG-Kriterien). Der Fonds zielt darauf ab, eine Gesamtrendite aus einem Portfolio von nachrangigen Schuldtiteln von Finanzinstituten zu erzielen. Mindestens die Hälfte der Anlagen des Fonds werden in nachrangige Bankschuldverschreibungen mit vergleichsweise hohem Ertrag investiert, oftmals von einer Kreditratingagentur mit einem Rating unter „Investment Grade“ bewertet. Nachrangige Bankschuldverschreibungen umfassen unter anderem Tier-1- und Tier-2-CoCo-Bonds und unbefristete US-Vorzugsaktien. Der Fonds darf nicht mehr als 10 % seiner Vermögenswerte in Wertpapiere ein und desselben Finanzinstituts investieren und kann bis zu 25 % seiner Vermögenswerte in Wertpapiere investieren.

Gemäß Artikel 8 der EU-Offenlegungsverordnung bewirbt der Fonds ökologische und soziale Merkmale und Investitionen, die Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung anwenden. Die vom Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmale bestehen darin, Anlagen in Emittenten zu favorisieren, deren Geschäftstätigkeiten und/oder Geschäftsgebaren einem angemessenen und verantwortungsvollen ESG-Ansatz folgen. Weitere Informationen zu den vom Fond beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen sind in Anhang 2 des Prospekts enthalten.

Der Fonds kann Derivate (wie Futures, Optionen und Swaps, die an die Wertentwicklung anderer Vermögenswerte gebunden sind) einsetzen, um ein Engagement in Basiswerten zu erreichen, zu erhöhen oder zu verringern, und kann dadurch einen Hebel erzeugen, der zu größeren Schwankungen des Fondswerts führen kann. Der Verwalter des Fonds stellt sicher, dass der Einsatz von Derivaten das Gesamtrisikoprofil des Fonds nicht wesentlich verändert.

Alle Details zum Anlageziel und zur Anlagepolitik des Fonds finden Sie im Prospekt.

Sie können Anteile an jedem Tag kaufen und verkaufen, der ein Geschäftstag in London und Luxemburg ist, vorbehaltlich der Bedingungen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ des Prospekts.

Kleinanleger-Zielgruppe

Dieses Produkt ist nur für qualifizierte institutionelle Anleger und/oder folgende Anleger verfügbar: (a) sachkundige Anleger mit durchschnittlichen Kenntnissen der relevanten Finanzprodukte (sachkundige Anleger können fundierte Anlageentscheidungen ausschließlich auf Grundlage der gesetzlich geregelten und genehmigten Angebotsdokumentation und der dort beschriebenen spezifischen Faktoren/Risiken treffen) oder einer gewissen Erfahrung in der Finanzbranche oder (b) erfahrene Anleger mit guten Kenntnissen der relevanten Finanzprodukte und Transaktionen oder Erfahrung in der Finanzbranche oder Unterstützung einer professionellen Anlageberatung oder Unterstützung eines beliebigen Portfolioservice.

Welche Risiken bestehen und was könnte ich im Gegenzug dafür bekommen?

Risikoindikator



Niedrigeres Risiko

Höheres Risiko

Der Gesamtrisikoindikator hilft Ihnen, das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten einzuschätzen. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, weil sich die Märkte in einer bestimmten Weise entwickeln oder wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen. Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, wobei 3 einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es äußerst unwahrscheinlich, dass die Fähigkeit des Fonds beeinträchtigt wird, Ihr Rückgabeverlangen auszuführen. Ungewöhnliche Marktbedingungen können weitere Risiken auslösen, zum Beispiel Kontrahentenrisiken oder Liquiditätsrisiken. Weitere Einzelheiten entnehmen Sie bitte dem Prospekt. Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.



Dieser Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 5 Jahre halten.

Performance-Szenarien

Was Sie bei diesem Produkt am Ende herausbekommen, hängt von der künftigen Marktentwicklung ab. Die künftige Marktentwicklung ist ungewiss und lässt sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen. Das dargestellte pessimistische, mittlere und optimistische Szenario veranschaulichen die schlechteste, durchschnittliche und beste Wertentwicklung des Produkts und/oder einer geeigneten Benchmark in den letzten 10 Jahren. Die Märkte könnten sich künftig völlig anders entwickeln.

| Empfohlene Haltedauer: 5 Jahre | | | |
|---------------------------------|--|---------------------------------|-----------------------------------|
| Anlage: 10.000 \$ | | | |
| Szenarien | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen |
| Minimum | Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Sie könnten Ihre Anlage ganz oder teilweise verlieren. | | |
| Stressszenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 2.520 \$ | 2.890 \$ |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -74,80 % | -21,98 % |
| Pessimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 7.740 \$ | 9.360 \$ |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | -22,60 % | -1,31 % |
| Mittleres Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 10.580 \$ | 14.310 \$ |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | 5,80 % | 7,43 % |
| Optimistisches Szenario | Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten | 13.480 \$ | 18.030 \$ |
| | Jährliche Durchschnittsrendite | 34,80 % | 12,51 % |

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen. Unberücksichtigt ist auch Ihre persönliche steuerliche Situation, die sich ebenfalls auf den am Ende erzielten Betrag auswirken kann. Das Stressszenario zeigt, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnten. Das pessimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 09.2021 und 01.2024. Das mittlere Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 04.2014 und 04.2019. Das optimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 02.2016 und 02.2021.

Was geschieht, wenn die BlueBay Funds Management Company S.A. nicht in der Lage ist, die Auszahlung vorzunehmen?

Anlegern muss bei einer Zahlungsunfähigkeit seitens BlueBay Funds Management Company S.A. nicht notwendigerweise ein finanzieller Verlust entstehen.

Die Vermögenswerte des Fonds werden bei seiner Verwahrstelle verwahrt: Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (die „Verwahrstelle“). Im Falle der Insolvenz von BlueBay Funds Management Company S.A. bleibt das bei der Verwahrstelle verwahrte Fondsvermögen unberührt. Im Falle der Insolvenz der Verwahrstelle oder einer Person, die in ihrem Namen handelt, könnte dem Fonds jedoch ein finanzieller Verlust entstehen. Dieses Risiko wird jedoch in gewissem Maße dadurch gemindert, dass die Verwahrstelle gesetzlich und aufsichtsrechtlich verpflichtet ist, ihre eigenen Vermögenswerte von den Vermögenswerten des Fonds zu trennen. Die Verwahrstelle haftet gegenüber dem Fonds auch für Verluste, die unter anderem durch Fahrlässigkeit, Betrug oder vorsätzliche Nichterfüllung ihrer Verpflichtungen entstehen (vorbehaltlich bestimmter Beschränkungen gemäß der Vereinbarung mit der Verwahrstelle). Anleger im Fonds sind von keinem Einlagensicherungssystem abgedeckt und könnten im schlimmsten Fall ihre gesamte Investition verlieren.

Welche Kosten entstehen?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten berechnen. Sollte dies der Fall sein, teilt diese Person Ihnen diese Kosten mit und legt dar, wie sich diese Kosten auf Ihre Anlage auswirken werden.

Kosten im Zeitverlauf

In den Tabellen werden Beträge dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten von Ihrer Anlage entnommen werden. Diese Beträge hängen davon ab, wie viel Sie anlegen, wie lange Sie das Produkt halten und wie gut sich das Produkt entwickelt. Die hier dargestellten Beträge veranschaulichen einen beispielhaften Anlagebetrag und verschiedene mögliche Anlagezeiträume.

Wir haben folgende Annahme zugrunde gelegt:

- Im ersten Jahr würden Sie den angelegten Betrag zurückerhalten (0 % Jahresrendite). Für die anderen Halteperioden haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt
- 10.000 \$ werden angelegt

| | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen | Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen |
|--|---------------------------------|-----------------------------------|
| Kosten insgesamt | 101 \$ | 735 \$ |
| Jährliche Auswirkungen der Kosten (*) | 1,0 % | 1,1 % pro Jahr |

(*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr voraussichtlich 8,51 % vor Kosten und 7,43 % nach Kosten betragen.

Zusammensetzung der Kosten

| Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg | | Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen |
|--|--|---------------------------------|
| Einstiegskosten | Wir berechnen keine Einstiegsgebühr. | 0 \$ |
| Ausstiegskosten | Wir berechnen keine Ausstiegsgebühr für dieses Produkt, die Person, die Ihnen das Produkt verkauft, kann jedoch eine Gebühr berechnen. | 0 \$ |
| Laufende Kosten pro Jahr | | |
| Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten | 0,80 % des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung auf der Grundlage der tatsächlichen Kosten des letzten Jahres. | 80 \$ |
| Transaktionskosten | 0,207 % des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die anfallen, wenn wir die zugrunde liegenden Anlagen für das Produkt kaufen oder verkaufen. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel wir kaufen und verkaufen. | 21 \$ |
| Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen | | |
| Erfolgsgebühren | Für dieses Produkt wird keine Erfolgsgebühr berechnet. | 0 \$ |

Wie lange sollte ich die Anlage halten, und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?

Empfohlene Haltedauer: 5 Jahre

Für diesen Fonds gilt kein Mindestanlagezeitraum, der Fonds ist jedoch für mittel- bis langfristige Anlagen gedacht und der empfohlene Mindestanlagezeitraum beträgt 5 Jahre. Der empfohlene Mindestanlagezeitraum richtet sich nach dem Risiko-Rendite-Profil des Fonds. Sie können Anteile am Fonds an jedem Tag verkaufen, der in London und Luxemburg ein Geschäftstag ist, ohne dass Ausstiegsgebühren anfallen. Wenn Sie jedoch vor Ablauf des empfohlenen Mindestanlagezeitraums verkaufen, besteht ein höheres Risiko für eine Wertschwankung des Fonds.

Wie kann ich mich beschweren?

Beschwerden können wie folgt schriftlich (entweder per E-Mail oder per Post) zu Händen des Complaints Handling Officers eingereicht werden:

BFMC_Complaints@bluebay.com oder BlueBay Funds Management Company S.A. 4, Boulevard Royal, L-2449 Luxemburg. Beschwerden können direkt oder über den Finanzintermediär des Anlegers eingereicht werden.

Sonstige zweckdienliche Angaben

Der Prospekt und die letzten Jahres- und Halbjahresberichte von BlueBay Funds in English, Deutsch, Französisch, Italienisch, Spanisch und Norwegisch sowie weitere nützliche Informationen wie die aktuellen Anteilspreise sind kostenlos am eingetragenen Sitz von BlueBay Funds, 80, route d'Esch, L-1470 Luxemburg und auf unserer Website unter www.rbcbbluebay.com erhältlich.

Informationen über die bisherige Leistung des Produkts in den letzten 10 Jahren sind verfügbar unter:

<https://rbcbbluebay.fundreporting.info/#/performance/past/LU1163205252/de?cpId=2204>

Frühere Berechnungen von Leistungsszenarien sind verfügbar unter:

<https://rbcbbluebay.fundreporting.info/#/performance/scenarios/LU1163205252/de?cpId=2204>