

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 des Produkts:	BlueBay Funds - BlueBay Financial Capital Bond Fund - A - USD (MFDiv)
Name des PRIIP-Herstellers:	BlueBay Funds Management Company S.A.
ISIN:	LU3049423802
Website:	www.rbcbluebay.com
Telefon:	+352 274 7571
Name der zuständigen Behörde:	Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF)
Dieses PRIIP ist zugelassen in:	Luxemburg
Datum der Erstellung des Basisinformationsblatts:	06/10/2025

Um welche Art von Produkt handelt es sich?

Art

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 Ertragserwirtschaftung und Vermehrung des ursprünglich investierten Betrags eine Rendite zu erreichen. Er investiert hauptsächlich in Anleihen von Finanzinstituten, die feste oder variable Zinsen zahlen.

Der Fonds wird aktiv verwaltet. Er verfügt über keine Benchmark und berücksichtigt ESG-Aspekte (Environmental, Social and Governance, also Umwelt-, soziale und die Unternehmensführung betreffende Aspekte). 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 % seines Vermögens in Wertpapieren ein und desselben Finanzinstituts und bis zu 25 % des Fondsvermögens in Aktien anlegen.

In Übereinstimmung mit Artikel 8 der SFDR bewirbt der Fonds ökologische und soziale Merkmale sowie Investitionen in

Unternehmen, 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 durch den Fonds beworbenen ökologischen und sozialen Merkmalen finden Sie in Anhang 2 des Prospekts.

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 Einzelheiten zum Anlageziel und der Anlagepolitik des Fonds finden Sie im Prospekt. Sie können Anteile an jedem Tag kaufen und verkaufen, wenn dieser entsprechend den Bedingungen im Abschnitt „Allgemeine Informationen“ des Prospekts ein Geschäftstag in London und Luxemburg ist.

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



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, was einer mittelniedrigen Risikoklasse entspricht. Das Risiko potenzieller Verluste aus der künftigen Wertentwicklung wird als mittelniedrig eingestuft. Bei ungünstigen Marktbedingungen ist es unwahrscheinlich, dass unsere Fähigkeit beeinträchtigt wird, Sie auszubezahlen.

Durch Auswirkungen ungewöhnlicher Marktbedingungen können weitere Risiken ausgelöst werden, 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.

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			
Anlagebeispiel:10,000 \$			
Szenarien		Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen
Minimum	Es gibt keine garantierte Mindestrendite, wenn Sie vor Ablauf von 5 Jahren aussteigen . Sie könnten Ihre Investition ganz oder teilweise verlieren.		
Stressszenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten	3,010 \$	3,290 \$
	Jährliche Durchschnittsrendite	-69.86%	-19.94%
Pessimistisches Szenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten	7,740 \$	10,870 \$
	Jährliche Durchschnittsrendite	-22.55%	1.68%
Mittleres Szenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten	10,860 \$	13,300 \$
	Jährliche Durchschnittsrendite	8.61%	5.87%
Optimistisches Szenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten herausbekommen könnten	13,490 \$	18,070 \$
	Jährliche Durchschnittsrendite	34.88%	12.57%

Das Stressszenario zeigt, was Sie im Fall extremer Marktbedingungen zurückerhalten könnten.

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 pessimistische Szenario ergab sich im Zeitraum 03 2018 - 03 2023.

Das mittlere Szenario ergab sich 03 2019 - 03 2024.

Das optimistische Szenario ergab sich 02 2016 - 02 2021.

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

Anleger erleiden durch den Ausfall von BlueBay Funds Management Company S.A. möglicherweise keinen finanziellen Verlust.

Die Vermögenswerte des Fonds werden von seiner Verwahrstelle, Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (die „Verwahrstelle“), verwahrt. 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 und wie lange Sie das Produkt halten. 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 USD werden angelegt

	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen
Kosten insgesamt	185 \$	1,090 \$
Jährliche Auswirkungen der Kosten (*)	1.8%	1.8% 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 7.5 % vor Kosten und 5.7 % nach Kosten betragen.

Zusammensetzung der Kosten

Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg		Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen
Einstiegskosten	Wir berechnen keine Einstiegsgebühr für dieses Produkt.	0 USD
Ausstiegskosten	Wir berechnen keine Ausstiegsgebühr für dieses Produkt, die Person, die Ihnen das Produkt verkauft, kann jedoch eine Gebühr berechnen.	0 USD
Laufende Kosten pro Jahr		
Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten	1.70% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung auf der Grundlage der tatsächlichen Kosten des letzten Jahres.	173 USD
Transaktionskosten	0.11 % 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.	11 USD
Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen		
Erfolgsgebühren	Für dieses Produkt wird keine Erfolgsgebühr berechnet.	

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 Officer 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.bluebay.com erhältlich.

Informationen zur früheren Wertentwicklung des Produkts in den letzten 10 Jahren finden Sie unter:

https://docs.publifund.com/pastperf/LU3049423802/de_DE

Berechnungen früherer Performance-Szenarien sind verfügbar unter:

https://docs.publifund.com/monthlyperf/LU3049423802/de_DE