# Wesentliche Anlegerinformationen

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen Teilfonds. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses Teilfonds und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

## MULTI ASSET DIVERSIFIED, ein Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-

Class "I - USD H Capitalisation " - ISIN code LU1353185314

Dieser Teilfonds wird von BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France verwaltet, einer Gesellschaft der Unternehmensgruppe BNP Paribas.

## Ziele und Anlagepolitik

Ziel des Teilfonds ist es, den Wert seiner Vermögenswerte mittelfristig durch ein Engagement in einem in Euro abgesicherten diversifizierten Korb aus Long/Short-Positionen zu steigern, dessen Komponenten mithilfe einer systematischen Auswahlmethode ausgewählt werden, die auf verschiedenen Anlageklassen basiert. Das Engagement in dem dynamischen Korb ist angepasst, um die jährliche Volatilität des Teilfonds auf einem Zielniveau von 10 % zu halten.

Das Anlageuniversum der Strategie setzt sich aus vier Anlageklassen zusammen: (i) Aktien, (ii) festverzinsliche Anlagen einschließlich Schuldtitel, (iii) Währungen und (iv) Rohstoffindizes. Der zur Auswahl der Basiswerte aus den einzelnen Anlageklassen verwendete Prozess basiert auf Kriterien in Zusammenhang mit geografischer Diversifizierung, Liquidität und Transparenz.
Es wird täglich eine automatische Umschichtung zwischen den verschiedenen Basiswerten mithilfe eines Algorithmus vorgenommen. Eine optimale Diversifizierung wird über die Anwendung eines systematischen Risiko-Rendite-Optimierungsmodells angestrebt, das auf historisch beobachteten Niveaus basiert (Wertentwicklung, Volatilität und Korrelation).

Die Umsetzung der Strategie erfolgt über den Finanzindex (der Strategieindex) BNP Paribas Cross Asset Trend Vol 10% (Bloomberg-Code: BNPICT10 Index) Der Strategieindex beruht auf einem systematischen, von BNP Paribas entwickelten Modell. Er wird bis zu einmal täglich über technische Anpassungen mittels systematischer Algorithmen neu gewichtet. Diese Methodik berücksichtigt bestimmte Gebühren, die die Nachbildung, Neugewichtung und Fixkosten abdecken. Die Kosten für die Nachbildung und Neugewichtung belaufen sich auf durchschnittlich 2,3 % jährlich, und die Fixgebühren liegen bei 0,5 % pro Jahr. Weitere Informationen zum Strategieindex finden Anleger auf der folgenden Website: https://indx.bnpparibas.com. Die vollständige Aufschlüsselung dieses Index und Angaben zur Wertentwicklung sind auf derselben Seite verfügbar. Die Berechnungsmethode für den Index ist direkt unter https://indx.bnpparibas.com/nr/CT10ER.pdf verfügbar.

Der Teilfonds verfolgt eine aktive Anlagestrategie. Der Teilfonds verfügt nicht über einen Referenzwert für den Vergleich der Wertentwicklung.

Die Strategie wird gemäß einer synthetischen Nachbildungspolitik durch den Abschluss von OTC-Derivaten umgesetzt. Die synthetische Nachbildungspolitik impliziert, dass der Teilfonds nicht tatsächlich die zugrunde liegenden Wertpapiere des Index hält, sondern stattdessen OTC-Derivate verwendet, um die Wertentwicklung des Strategieindex zu erzielen. Der Teilfonds investiert zu jeder Zeit mindestens 75 % seines Nettovermögens in Aktien, die von Unternehmen begeben werden, die ihren eingetragenen Sitz in einem Mitgliedstaat des Europäischen Wirtschaftsraums haben.

Anleger können an jedem Tag, an dem die Börsen in Frankreich, Deutschland, dem Vereinigten Königreich, Schweden, der Schweiz, den USA, Kanada, Brasilien, Japan, Taiwan, Südkorea, Hongkong und Australien den ganzen Tag geöffnet sind und an dem USD, CLP, COP, PHP und INR abgerechnet werden (außer samstags und sonntags sowie an luxemburgischen und französischen Feiertagen), Anteile zeichnen oder zurückgeben.
Zeichnungs- und Rücknahmeanträge können vor 16:00 Uhr (MEZ) spätestens einen Tag vor dem relevanten Bewertungstag bei der Verwaltungsstelle eingereicht werden.
Verwaltungsstelle: BNP Paribas Securities Services, Niederlassung Luxemburg, 60, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.
Die Erträge werden systematisch wieder angelegt.

## Risiko- und Ertragsprofil

Niedrigeres Risiko — Höheres Risiko



Potenziell niedrigere Rendite — Potenziell höhere Rendite

| 1 | 2 | 3 | 4 | **5** | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

- Die historischen Daten, die zur Berechnung des synthetischen Indikators verwendet wurden, sind kein verlässlicher Hinweis auf das künftige Risikoprofil des Teilfonds.
- Die diesem Teilfonds zugewiesene Risikokategorie stellt keine Garantie dar und kann sich im Laufe der Zeit ändern
- Die niedrigste Kategorie kann nicht mit einer „risikofreien" Anlage gleichgesetzt werden.

Die Risikokategorie ergibt sich aus der aktiven Anlage in unterschiedlichen Anlagenklassen, während gleichzeitig ein Erhalt des Risikoprofils zwischen vordefinierten Grenzen angestrebt wird.

Nicht im Indikator berücksichtigte erhebliche Risiken, deren Eintreten zu einem Rückgang des Nettoinventarwerts führen kann:

- Ausfallrisiko der Gegenpartei: Dieses Risiko ist mit der Fähigkeit der Gegenpartei einer außerbörslichen Finanztransaktion verbunden, ihre Verpflichtungen (z. B. Zahlung, Lieferung, Rückerstattung) zu erfüllen.
- Risiko im Zusammenhang mit dem Einsatz von Finanzterminstrumenten: Wir nutzen außerbrslich gehandelte Finanzterminstrumente, um die Performance der Strategie nachzubilden. Diese Instrumente können mit einer Reihe von Risiken verbunden sein, die zu Anpassungen oder sogar zur vorzeitigen Kündigung des Instruments und damit zu einer möglichen Beeinträchtigung des Nettoinventarwerts führen können.

## Kosten

Die von Ihnen getragenen Kosten und Gebühren dienen der laufenden Verwaltung des Teilfonds, einschließlich der Kosten für die Vermarktung und den Vertrieb der Aktien. Diese Kosten verringern die Ertragschancen Ihrer Anlage.

| | |
|---|---|
| Einmalige Kosten vor und nach der Anlage | |
| **Ausgabeaufschläge** | Entfällt |
| **Rücknahmeabschläge** | Entfällt |
| Kosten, die der OGAW innerhalb eines Jahres zu tragen hat | |
| **Laufende Kosten** | 0,76%(*) |
| Kosten, die der OGAW unter bestimmten Umständen zu tragen hat | |
| **An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren** | Entfällt |

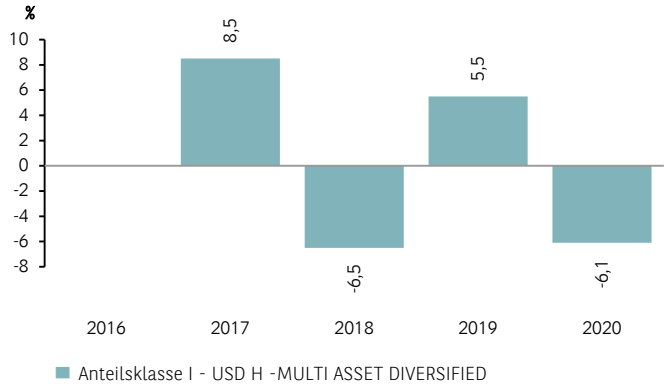
Die Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge sind Höchstsätze. In bestimmten Fällen sind diese Kosten geringer. Informationen über die aktuellen Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge erhalten Anleger von ihren Beratern oder Finanzvermittlern.
(*) Diese Schätzung der laufenden Kosten basiert auf den laufenden Kosten des vorherigen Geschäftsjahres zum Dezember 2020. Der Betrag kann von Jahr zu Jahr variieren.Laufende Kosten umfassen nicht:

- Maklergebühren, mit Ausnahme der Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge, die der Teilfonds im Rahmen des Kaufs oder Verkaufs von Anteilen eines anderen Instruments für gemeinsame Anlagen zahlt.

Bei einem Umtausch kann Anlegern eine Gebühr von maximal 1,5 % berechnet werden.

**Weitere Informationen zu den Kosten finden Sie im Abschnitt „Kosten und Gebühren" des Verkaufsprospekts des Teilfonds, der auf der Website www.bnpparibas-am.com eingesehen werden kann.**

## Wertentwicklung in der Vergangenheit




- Die frühere Wertentwicklung lässt keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu;
- Die Wertentwicklung wird ohne Verwaltungskosten berechnet.;
- Die Aktienklasse wurde am 12 August 2016 aufgelegt.
- Die frühere Wertentwicklung wurde in USD berechnet.

## Praktische Informationen

- Depotbank: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH
- Diese wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) beschreiben einen Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-. Der Prospekt und die periodischen Berichte werden für die gesamte im Titel des Dokuments genannte SICAV gemeinsam erstellt.
- Einzelheiten zur aktualisierten Vergütungspolitik sind auf der Website http://www.bnpparibas-am.com/en/remuneration-disclosure oder auf formlose schriftliche Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft erhältlich.
- Anleger können Anteile zwischen den Fonds von THEAM QUANT- umschichten. Einzelheiten hierzu erfahren Sie im Verkaufsprospekt oder von Ihrem Finanzberater.
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Verkaufsprospekts der SICAV vereinbar ist.
- Die wesentlichen Anlegerinformationen, der Prospekt sowie die letzten Jahres- und Zwischenberichte des Teilfonds werden auf formlose schriftliche Anfrage der Anteilinhaber übermittelt. Die Anfrage ist zu richten an: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - MAQS CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09.
- Der Preis der Anteile der SICAV ist auf der Website www.bnpparibas-am.com verfügbar.
- Informationen zu den übrigen Aktien des Teilfonds entnehmen Sie bitte dem Verkaufsprospekt des Teilfonds.
- Je nach anwendbaren Steuervorschriften können etwaige Wertzuwächse und Erträge aus den an diesem Teilfonds gehaltenen Anteilen einer Besteuerung unterliegen. Wir empfehlen Ihnen, sich diesbezüglich bei einem Steuerberater zu erkundigen.

Der Teilfonds wurde in Luxemburg zugelassen und wird von der Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) reguliert.
Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand von 19 Februar 2021.