

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 DEFENSIVE, ein Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-

Class "I-GBP H Capitalisation " - ISIN code LU1353188334

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

Ziele und Anlagepolitik

Der Teilfonds ist bestrebt, den Wert seiner Vermögenswerte mittelfristig durch ein Engagement in einem diversifizierten Portfolio zu steigern, dessen Komponenten mithilfe einer systematischen Auswahlmethode ausgewählt werden, die auf verschiedenen Anlageklassen (Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Rohstoffe und Immobilien) basiert. Das Engagement in dem Portfolio wird jedoch angepasst, um die jährliche Volatilität des Teilfonds auf einem Zielniveau von 5 % zu halten.

Um sein Anlageziel zu erreichen, implementiert der Teilfonds eine systematische Anlagestrategie (die „Strategie“), die Long und begrenzte Short-Positionen einbezieht, was zu einer Netto-Long-Position in jeder Anlageklasse (Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Rohstoffe und Immobilien) führt.

Die Strategie profitiert von einem systematischen Risikokontrollmechanismus, der darauf abzielt, die jährliche Volatilität auf einem Zielniveau von 5% zu halten. Infolgedessen kann die Strategie auf dem Geldmarkt engagiert sein.

Das Anlageuniversum der Strategie setzt sich aus vier Anlageklassen zusammen: (i) Aktien, (ii) festverzinsliche Wertpapiere, (iii) Rohstoffe und (iv) Immobilien ((iii) und (iv) durch Indizes). 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). Der Allokationsmechanismus zielt darauf ab, ein Netto-Long-Engagement in jeder Anlageklasse zu bieten.

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

Die Strategie wird entweder gemäß einer synthetischen Nachbildungspolitik, durch den Abschluss von OTC-Derivaten oder durch physische Nachbildung umgesetzt. In letzterem Fall betrifft die physische Nachbildung die Long-Positionen des dynamischen Korbs.

Wenn die Strategie entsprechend der synthetischen Nachbildungspolitik implementiert wurde, investiert der Teilfonds sein Vermögen in übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente (die Finanzierungsanlagen) und tauscht die Performance von bis zu 100 % der Finanzierungsanlagen über OTC-Derivate um, um ein Engagement in der Strategie zu erlangen. Die zugrunde liegenden Vermögenswerte bestehen hauptsächlich aus Finanzindizes oder Futures auf Aktien, festverzinslichen Anlagen, Immobilien und Rohstoffindizes.

Im Falle einer synthetischen Nachbildungspolitik investiert der Teilfonds stets mindestens 75 % seines Nettovermögens in Aktien und/oder als Aktien gleichwertig behandelte Wertpapiere, die von Unternehmen aus beliebigen Ländern begeben werden, sofern es sich um Länder handelt, die am Kampf gegen Betrug und Steuerhinterziehung teilnehmen. Der verbleibende Teil, d. h. maximal 25 % des Vermögens, kann in anderen übertragbaren Wertpapieren, Derivaten, Geldmarktinstrumenten und/oder Barmitteln und - bis maximal 15 % des Nettovermögens - in Schuldtiteln beliebiger Art sowie - bis maximal 10 % des Nettovermögens - in anderen OGAW und/oder OGA angelegt werden.

Anleger können an jedem Tag, an dem die Börsen in Paris, London, Frankfurt, New York, Tokio und Hongkong den ganzen Tag geöffnet sind und an dem EUR, GBP und USD abgerechnet werden (außer samstags und sonntags sowie an luxemburgischen und französischen Feiertagen), Anteile zeichnen oder zurückgeben.

Zeichnungs- und Rücknahmeanträge können bis spätestens vor 16:00 Uhr (MEZ) am 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.

- Kreditrisiko:** Risiko der Herabstufung des Ratings eines Emittenten oder seines Zahlungsausfalls, was zu einem sinkenden Wert der Finanzinstrumente führen kann, die mit ihm verbunden sind.

- Risiko im Zusammenhang mit dem Einsatz von Finanztermininstrumenten:** Wir nutzen außerbörslich gehandelte Finanztermininstrumente, 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 | 0,66% ^(*) |
| Kosten, die der OGAW unter bestimmten Umständen zu tragen hat | |
| An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren | Entfällt |

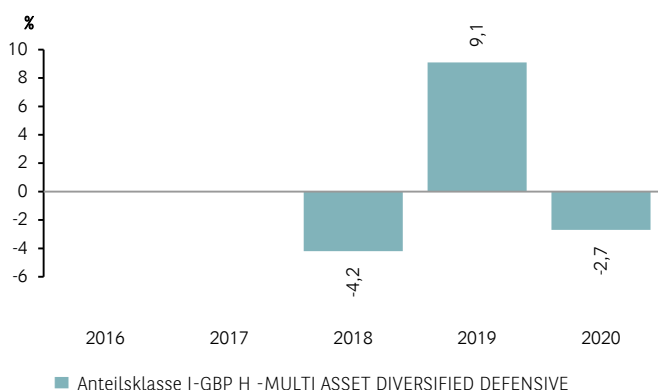
Die Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge sind Höchstsätze. In bestimmten Fällen sind diese Kosten geringer. Informationen über die aktuellen Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge erhalten Anleger von ihren Beratern oder Finanzvermittlern. (*) Diese Schätzung der laufenden Kosten basiert auf den laufenden 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 2 März 2017 aufgelegt.
- Die frühere Wertentwicklung wurde in GBP 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.
- Mitteilung für Anleger in der Schweiz: Der Verkaufsprospekt, das Dokument mit den wesentlichen Anlegerinformationen, die Gesellschaftssatzung sowie der Jahres- und Halbjahresbericht sind kostenfrei bei der Vertretung in der Schweiz, BNP Paribas Securities Services, Paris, Zweigstelle Zürich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zürich, erhältlich. Als Zahlstelle in der Schweiz agiert BNP Paribas Securities Services, Paris, Zweigstelle Zürich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zürich.

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.