

Wesentliche Anlegerinformationen

Dieses Dokument enthält wichtige Informationen für Anleger dieses 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.

Equity iESG Eurozone Income Defensive, ein Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-

Klasse „C EUR Capitalisation“- ISIN-Code LU1480593141

Dieser Teilfonds wird von BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France verwaltet, einem Unternehmen der BNP Paribas-Gruppe.

Ziele und Anlagepolitik

Ziel des Teilfonds ist es, Einkommen und Kapitalwachstum (i) zu erzielen, indem er einem Korb von Aktien mit hohen Dividenden der Europäischen Wirtschafts- und Währungsunion (der «Eurozone») ausgesetzt wird und dabei Umwelt-, Kriterien für Social and Governance (Social and Governance) und (ii) durch die Implementierung einer systematischen Optionsstrategie, die durch die Minimierung der Volatilität im Teilfonds auf die Generierung zusätzlicher Erträge und die Risikominderung abzielt.

Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Teilfonds eine quantitative Anlagestrategie (die Strategie) um, die zwei Säulen der Wertentwicklung vereint:

(A) ein langfristiger Exposure in einem Korb von Aktien mit hohen Dividenden in der Eurozone (dem Portfolio mit hohen Dividenden), der aus den folgenden Schritten besteht:

(i) Definition des Investmentuniversums, das aus führenden Aktien der Eurozone mit hoher Marktkapitalisierung besteht, die nach einem erstklassigen Ansatz eine angemessene Liquidität bieten und die minimalen Anforderungen an die Kapitalrendite erfüllen. Ausgeschlossen sind insbesondere Unternehmen, die in Sektoren mit potenziell hohen negativen Auswirkungen auf die Umweltbelastung durch die Umweltbelastung involviert sind, Unternehmen, die erheblichen Verletzungen der Prinzipien des Global Compact der Vereinten Nationen unterliegen und die in ernsthafte Kontroversen im Zusammenhang mit der Umweltbelastung verwickelt waren.

(ii) Auswahl der Aktien auf der Grundlage grundlegender Kriterien wie dem Dividendenwachstumspotenzial und der Qualität des Geschäftsmodells.

(iii) der Ansatz der Integration von Unternehmen, der darin besteht, die Bewertungen von Unternehmen in das Allokationsmodell zu integrieren, indem die oben genannte grundlegende Bewertung von Unternehmen auf der Grundlage ihrer Bewertung von Unternehmen geändert wird, wobei die am besten von der Europäischen Integritätsbewertung bewerteten Unternehmen nach folgenden Kriterien bevorzugt werden: Aber nicht beschränkt auf Energieeffizienz, Achtung der Menschen- und Arbeitnehmerrechte, Unabhängigkeit des Verwaltungsrats.

(iv) Sicherstellung der minimalen Ziele für die Umweltbelastung und den CO₂-Ausstoß, die aus einer geringeren CO₂-Bilanz und einer besseren Bewertung des endgültigen Strategieportfolios im Vergleich zu einem Referenzmarkt-Investmentuniversum bestehen.

v) Einführung eines Allokationsmechanismus, der darauf abzielt, das relative Risiko des endgültigen Portfolios gegenüber dem Referenzmarkt zu kontrollieren, und insbesondere eine Kontrolle des Ex-ante-Tracking-Fehlers unter 4 % im Hinblick auf den Euro STOXX Net Return EUR Index (Bloomberg Code: SXXT).

(b) eine ergänzende systematische Optionsstrategie für den Euro Stoxx 50-Index, die das Risiko-Rendite-Verhältnis im Vergleich zu einer Direktinvestition im Strategy Index verbessern soll, indem sie Short-Positionen für Call-Optionen auf dem Euro Stoxx 50-Index übernimmt, die darauf abzielen, zusätzliche Einnahmen zu erzielen und gleichzeitig die des Teilfonds zu begrenzen Volatilität und Long-Positionen auf Put-Optionen im Euro Stoxx 50 Index, um die Volatilität des Teilfonds zu reduzieren.

Eine außerfinanzielle Strategie kann methodische Einschränkungen umfassen, wie das Risiko im Zusammenhang mit den Investitionen in die Unternehmensgewichtung oder das Risiko im Zusammenhang mit einer systematischen Allokation unter Einbeziehung außerfinanzieller Kriterien.

Das High-Dividend-Portfolio wird über den BNP Paribas Quality Dividend Eurozone-Index (der High-Dividend-Index) implementiert, der auf einem von BNP Paribas entwickelten quantitativen Algorithmus basiert und jeden Monat mithilfe eines spezifischen Algorithmus neu ausgeglichen wird. Die monatliche Neuausrichtung beinhaltet keine Kosten für den Strategieindex. Die vollständige Aufschlüsselung des High-Dividendenindex ist auf der Website verfügbar: <https://indx.bnpparibas.com>. Die Indexberechnungsmethode ist direkt unter <https://indx.bnpparibas.com/nr/FEDZTR.pdf> verfügbar

Die Strategie des Teilfonds gilt als aktiv. Der Teilfonds verfügt über keine Benchmark für den Leistungsvergleich. Die Strategie wird gemäß einer Richtlinie für die synthetische Replikation durch den Abschluss von OTC-Derivaten umgesetzt. Die Synthetic Replication Policy impliziert, dass der Subfonds nicht die der Strategie zugrunde liegenden Wertpapiere hält, sondern sich stattdessen auf OTC-Derivate verlässt, um die Performance der Strategie zu erzielen. Der Teilfonds investiert jederzeit mindestens 75 % seines Nettovermögens in Aktien, die von Unternehmen ausgegeben werden, die ihren Sitz in einem Mitgliedstaat des Europäischen Wirtschaftsraums haben.

Investoren können jeden Tag, an dem die Börsen in Paris, Frankfurt, Amsterdam, Madrid und Mailand den ganzen Tag geöffnet sind, abonnieren oder einlösen (außer an Samstagen und Sonntagen sowie an luxemburgischen und französischen Feiertagen).

Der Antrag auf ein Abonnement und Einlösung kann bis spätestens 12,00 Uhr (MEZ) am jeweiligen Bewertungstag an den Verwaltungsagenten gestellt werden.

Verwaltungsagent: BNP Paribas Securities Services, Niederlassung Luxemburg, 60 Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburg, Großherzogtum Luxemburg.

Die Erträge werden grundsätzlich reinvestiert.

Risiko- und Ertragsprofil

Geringeres Risiko

Höheres Risiko

Typischerweise geringerer Ertrag

Typischerweise höherer Ertrag

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

- Die Wertentwicklung in der Vergangenheit, wie beispielsweise die Informationen zur Berechnung des synthetischen Indikators, ist möglicherweise kein zuverlässiger Indikator für das zukünftige Risikoprofil des Teilfonds.

- Für die mit dem Teilfonds verbundene Risikokategorie besteht keine Garantie und sie kann sich im Laufe der Zeit ändern.

- Die niedrigste Kategorie bedeutet nicht „risikofrei“.

Die Risikokategorie ergibt sich aus der Anlage in einer Aktienstrategie, die darauf abzielt, das Risiko und die Volatilität zu reduzieren, die mit Aktien verbunden sind.

Weitere Risiken, die für den Fonds materiell relevant sind und durch den Indikator nicht angemessen erfasst werden:

- 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 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.

- Liquiditätsrisiko:** Dieses Risiko entsteht, wenn es wegen eines Mangels an Käufern nicht möglich ist, Vermögenswerte zu einem gewünschten Zeitpunkt zu einem fairen Marktpreis zu verkaufen.



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The sustainable investor for a changing world

Kosten

Die gezahlten Kosten und Gebühren werden verwendet, um die Kosten für den Betrieb des Teilfonds, einschließlich der Kosten für Marketing und den Vertrieb von Aktien zu decken; diese Gebühren reduzieren das potenzielle Wachstum von Anlagen.

Einmalige Kosten vor und nach der Anlage	
Ausgabeaufschläge	3,00%
Rücknahmeabschläge	entfällt
Dabei handelt es sich um den Höchstbetrag, der vor der Anlage von Ihrem Kapitalbetrag abgezogen wird.	
Kosten, die vom OGAW im Laufe eines Jahres abgezogen werden	
Laufende Kosten	1,54% (*)
Kosten, die der OGAW unter bestimmten Umständen zu tragen hat	
An die Wertentwicklung des	entfällt

Der ausgewiesene Ausgabeaufschlag und der ausgewiesene Rücknahmeabschlag sind Höchstwerte. In manchen Fällen zahlen Sie möglicherweise einen geringeren Betrag. Einzelheiten dazu erfahren Sie von Ihrem Finanzberater.

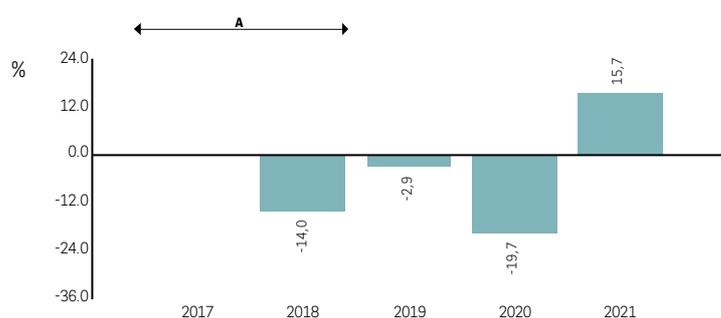
(*) Die ausgewiesenen **laufenden Kosten** basieren auf früheren Aufwendungen ermittelt zum 31. Dezember 2021.

Dieser Wert kann von Jahr zu Jahr schwanken. Nicht enthalten sind:

- An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren.
 - Vermittlungsgebühren, außer im Falle eines Ausgabeaufschlags und/oder Rücknahmeabschlags, den der Teilfonds beim Kauf bzw. Verkauf von Anteilen in einer anderen kollektiven Kapitalanlage gezahlt hat.
- Bei einem Umtausch kann Anlegern eine Gebühr von maximal 1.5% berechnet werden.

Weitere Informationen über Kosten finden Sie im Abschnitt „Gebühren und Kosten“ des Verkaufsprospekts für die SICAV. Dieser ist online unter der folgenden Adresse verfügbar: <http://www.bnpparibas-am.com>.

Frühere Wertentwicklung



■ Aktienkategorie C - Equity iESG Eurozone Income Defensive

A: 09/2017 - 04/2018 : Aufgrund einer Kapitalmaßnahme am 26.04.2018 beinhalten die ausgewiesenen Wertentwicklungen ab diesem Zeitpunkt die simulierte frühere Wertentwicklung und die simulierten Gebühren des THEAM Quant Equity Eurozone Income Defensive [C EUR ACC].

- Die frühere Wertentwicklung lässt keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu.
- Die Wertentwicklung wird ohne Verwaltungskosten berechnet.
- Die Aktienklasse wurde am 26. April 2018 aufgelegt.
- Die frühere Wertentwicklung wurde im Jahr EUR berechnet.

Praktische Informationen

- Depotbank: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH.
- Die vorliegenden wesentlichen Anlegerinformationen beschreiben einen Teilfonds der THEAM QUANT- SICAV; der Prospekt und regelmäßigen Berichte gelten für den gesamten in der Dokumentüberschrift genannten SICAV.
- Die Einzelheiten zur aktualisierten Vergütungspolitik sind online unter <https://www.bnpparibas-am.com/en/footer/remuneration-policy> oder auf schriftliche Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft verfügbar.
- 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 SICAV-Prospekts vereinbar ist.
- Die wesentlichen Anlegerinformationen, der Verkaufsprospekt und die aktuellen Jahres- und Zwischenberichte des Teilfonds werden den Anteilhabern innerhalb von acht Werktagen nach Erhalt einer schriftlichen Anfrage an folgende Adresse zugesendet: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09.
- Der Preis der SICAV-Anteile ist online unter <http://www.bnpparibas-am.com> verfügbar.
- Weitere Informationen über andere Anteile des Teilfonds finden Sie im Prospekt des Teilfonds.
- Abhängig von Ihrem Steuersystem können Kapitalgewinne und Erträge im Zusammenhang mit dem Besitz von Aktien dieses Teilfonds der Besteuerung unterliegen. Wir empfehlen Ihnen, sich für weitere Informationen zu diesem Thema an Ihren Steuerberater zu wenden.

Dieser Teilfonds ist im Großherzogtum Luxemburg zugelassen und wird durch die „Commission de Surveillance du Secteur Financier“ reguliert. Diese wesentlichen Anlegerinformationen sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 18. Februar 2022.

