

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.

EQUITY US PREMIUM INCOME, ein Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-

Class "I USD Capitalisation" - ISIN code LU1480597480

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

Ziele und Anlagepolitik

Ziel des Teilfonds ist es, Erträge und Kapitalzuwachs durch die Umsetzung einer systematischen Optionsstrategie für eine Auswahl von US-Aktien zu erzielen, die darauf abzielt, Erträge in optimistischen und leicht pessimistischen Märkten zu erzielen. Der Teilfonds strebt Erträge in Höhe von 5 % pro Jahr an. Es kann jedoch nicht garantiert werden, dass er dieses Ziel erreicht.

Um sein Anlageziel zu erreichen, implementiert der Teilfonds eine quantitative Anlagestrategie (die „Strategie“), die darin besteht, über den BNP Paribas Stock Put Write US Index (der „Strategieindex“) Short-Put-Optionen auf eine Auswahl an US-amerikanischen Aktien zu verkaufen.

Das Modell, das verwendet wird, um den Strategieindex aufzubauen, zielt darauf ab:

- die Aktien auf monatlicher Basis (Neugewichtung) nach einem Prozess auszuwählen, der auf Fundamentaldaten und Marktkriterien basiert. Ziel ist es, das Anlageuniversum zu prüfen, um die Aktien zu identifizieren, die von einem nachhaltigen Geschäftsmodell, einer vorteilhaften Kursdynamik, einer hohen durchschnittlichen Marktkapitalisierung, einer geringen Wechselwirkung mit US-Aktien, einer attraktiven Bewertung der Optionsprämie und vorteilhaften Handelsbedingungen auf dem Optionsmarkt profitieren. Das Anlageuniversum des Strategieindex besteht aus den größten Börsenkapitalisierungen der USA, die zufriedenstellende Liquiditätsbedingungen bieten.
- dynamischer Verkauf von kurzfristigen Out-of-the-money-Put-Optionen auf jede der durch den oben genannten Prozess ausgewählten Aktien zu gleichen Teilen („Put-Write-Strategie“). Put-Write-Strategien zielen darauf ab, Erträge zu erzielen und gleichzeitig die Gesamtvolatilität zu begrenzen, und sind besonders in optimistischen und leicht pessimistischen Märkten geeignet.

Der Strategieindex ist ein diversifizierter Index, der auf einem von BNP Paribas entwickelten quantitativen Algorithmus basiert. Eine vollständige Aufschlüsselung des Strategieindex finden Sie auf folgender Website: <https://indx.bnpparibas.com>. Die Berechnungsmethode für den Index ist direkt verfügbar unter: <https://indx.bnpparibas.com/nr/SPUSTR.pdf>.

Anleger sollten beachten, dass mit dem dynamischen Verkauf kurzfristiger Put-Optionen verbundene jährliche Nachbildungskosten und zusätzliche Kosten aus der Verwaltung des Put-Write-Strategie-Portfolios an jedem Neugewichtungstag anfallen. Diese Kosten verringern die Wertentwicklung des Strategieindex und indirekt die Wertentwicklung des Teilfonds.

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

Die Umsetzung der Strategie durch den Teilfonds erfolgt anhand eines Grundsatzes der synthetischen Nachbildung durch den Abschluss von OTC-Derivaten.

Der Grundsatz der synthetischen Nachbildung beinhaltet, dass der Teilfonds sein Vermögen in übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente (die „Finanzierungsanlagen“) investiert und die Performance von bis zu 100 % der Finanzierungsanlagen über OTC-Derivate umtauscht, um ein Engagement in der Strategie zu erlangen. Im Rahmen des Grundsatzes der synthetischen Nachbildung investiert der Teilfonds zu jeder Zeit mindestens 75 % seines Nettovermögens in Aktien und/oder als Aktien gleichwertig behandelte Wertpapiere, die von Unternehmen aus beliebigen Ländern begeben werden.

Anleger können an jedem Tag, an dem die Börse in New York den ganzen Tag geöffnet ist (außer samstags und sonntags sowie an luxemburgischen und französischen Feiertagen), Anteile zeichnen oder zurückgeben.

Zeichnungs- und Rücknahmeanträge können bis spätestens vor 12:00 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 ist durch die Wertentwicklung des Strategieindex gerechtfertigt, der stark nach oben oder unten variieren kann, was möglicherweise zu raschen und erheblichen Wertänderungen der Anlage führt.

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 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 durch die Schwierigkeit, einen Titel aufgrund fehlender Käufer zu seinem angemessenen Wert und innerhalb einer vertretbaren Frist zu veräußern.

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 18 Juli 2017 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.