

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 Protected, ein Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-

Class "Protected I EUR Capitalisation" - ISIN code LU1539110459

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 seine jährliche Volatilität auf einem Zielniveau von 10 % zu halten. Der Teilfonds wird zusätzlich durch einen Schutzmechanismus des Bürgen abgesichert, wobei der Nettoinventarwert je Anteil in jeder Klasse an jedem Bewertungstag mindestens 80 % des maximalen Nettoinventarwerts je Anteil der Klasse, der im vorangegangenen Jahr erreicht wurde, entspricht (siehe unten).

Das Anlageuniversum der Multi-Asset-Strategie mit dynamischem Korb („die Strategie“) setzt sich aus den folgenden vier Anlageklassen zusammen: (i) Aktien, (ii) festverzinsliche Anlagen einschließlich Schuldtiteln, (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 der Strategie 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).

Das Engagement in der Strategie ist variabel und wird über den gleitenden Schutzmechanismus, wie unten definiert, festgelegt.

Die Strategie wird durch die Nutzung des Finanzindex (der „Strategieindex“) BNP Paribas Cross Asset Trend Vol 10% (Bloomberg-Code: BNPICT10 Index) umgesetzt. Der Strategieindex beruht auf einem systematischen, von BNP Paribas entwickelten Modell. Er wird bis zu einmal täglich über technische Anpassungen mittels eines spezifischen Algorithmus 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 des Index finden Sie direkt unter: <https://indx.bnpparibas.com/nr/CT10ER.pdf>

Der mit jeder Klasse verbundene Schutzmechanismus wird durch das Engagement in (i) Barmitteln oder Geldmarktinstrumenten auf einer Basis, die mindestens dem Schutzniveau entsprechen muss, und (ii) einer Call-Option der Strategie aktiviert. Fiktive Call-Optionen und Parameter werden mithilfe eines quantitativen Mechanismus erzielt und ändern sich täglich, je nach der Wertentwicklung der Strategie und dem Schutzniveau der einzelnen Klassen, das durch den gleitenden Schutzmechanismus erreicht wird.

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 entweder (i) seine Vermögenswerte in übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente investiert (die „Finanzierungs-Vermögenswerte“) und die Performance von bis zu 100 % der Finanzierungs-Vermögenswerte durch OTC-Derivate tauscht, um ein Engagement in der Strategie einzugehen, oder (ii) ein OTC-Derivat mit einem anfänglichen Umtausch der Nettoerlöse aus der Ausgabe von Anteilen schließt, um ein Engagement in der Strategie einzugehen. Die zugrunde liegenden Vermögenswerte bestehen hauptsächlich aus Finanzindizes oder Futures auf Aktien, festverzinslichen Anlagen einschließlich Schuldtiteln, Währungen und Rohstoffindizes.

Der Teilfonds kann auch in andere übertragbare Wertpapiere und Barmittel und bis zu 10 % seines Nettoinventarwerts in OGAW und/oder andere OGA investieren. Die gesamte Anlage in Geldmarktinstrumenten und/oder Barmitteln, in Schuldtiteln jeglicher Art sowie in OGAW und/oder OGA darf 25 % des Nettoinventarwerts nicht überschreiten.

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 (außer samstags und sonntags sowie an luxemburgischen und französischen Feiertagen), Anteile zeichnen oder zurückgeben. Zeichnungs- und Rücknahmeanträge können vor 16:00 Uhr (MEZ) spätestens 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 Anlage in verschiedene Anlagenklassen mit einem Standard-Anlageportfolio, das einen hohen Anteil an riskanten Vermögenswerten und einen niedrigen Anteil an weniger riskanten Vermögenswerten enthält. Ferner zielt die Anlagestrategie auf eine Verlustbegrenzung während Einjahreszeiträumen ab.

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.

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

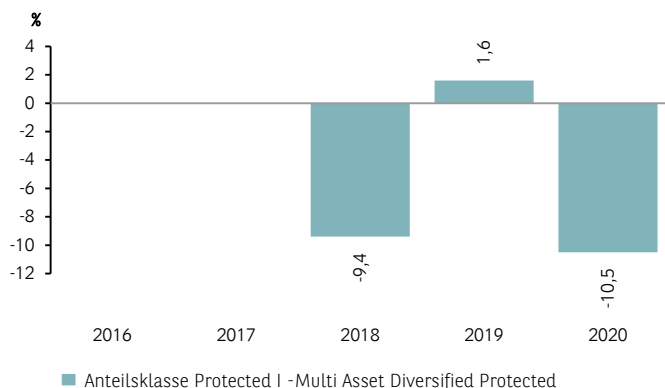
Die Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge sind Höchstsätze. In bestimmten Fällen sind diese Kosten geringer. Informationen über die aktuellen Ausgabeauf- und Rücknahmeabschläge erhalten Anleger von ihren Beratern oder Finanzvermittlern. (*) Diese Schätzung der laufenden Kosten basiert auf den laufenden 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 30 Juni 2017 aufgelegt.
- Die frühere Wertentwicklung wurde in EUR 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 Anteilhaber 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.