

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.

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

Klasse „I GBP RH GBP Capitalisation“- ISIN-Code LU1353188334

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

Ziele und Anlagepolitik

Der Teilfonds strebt eine mittelfristige Wertsteigerung seiner Vermögenswerte an, indem er einem diversifizierten Portfolio ausgesetzt wird, dessen Komponenten mithilfe einer systematischen Auswahlmethode auf der Grundlage verschiedener Anlageklassen (Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Rohstoffe und Immobilien) ausgewählt werden. Das Engagement im Portfolio wird jedoch angepasst, um die jährliche Volatilität des Teilfonds auf einem Zielniveau von 5% zu halten.

Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Teilfonds eine systematische Anlagestrategie (die Strategie) um, 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 könnte die Strategie dem Geldmarkt ausgesetzt 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). Das Verfahren zur Auswahl des Basiswertes aus jeder Anlageklasse basiert auf Kriterien in Bezug auf geografische Diversifizierung, Liquidität und Transparenz.

Eine automatische Neuzuweisung zwischen den verschiedenen zugrunde liegenden wird täglich mithilfe eines Algorithmus durchgeführt. Eine optimale Diversifizierung ist durch die Anwendung eines systematischen Optimierungsmodells für Risiko/Rendite zu erreichen, das auf historisch beobachteten Niveaus (Performance, Volatilität und Korrelation) basiert. Der Allokationsmechanismus zielt darauf ab, ein Netto-Long-Engagement für jede Anlageklasse bereitzustellen.

Die Strategie des Teilfonds gilt als aktiv. Der Teilfonds verfügt über keine Benchmark für den Leistungsvergleich.

Die Strategie wird entweder gemäß einer Richtlinie für die synthetische Replikation, durch den Abschluss von OTC-Derivaten oder durch physische Replikation implementiert. Im letzteren Fall betrifft die physische Replikation die langen Positionen des dynamischen Korbes.

Wenn die Strategie gemäß der Synthetic Replication Policy umgesetzt wird, investiert der Teilfonds seine Vermögenswerte in übertragbare Wertpapiere oder Geldmarktinstrumente (die Finanzierungsaktiva) und tauscht die Performance von bis zu 100 % der Finanzierungsaktiva über OTC-Derivate aus, um sich an der Strategie zu beteiligen. Die zugrunde liegenden Vermögenswerte werden hauptsächlich aus Finanzindizes oder Futures auf Aktien, festverzinsliche Wertpapiere, Immobilien und Rohstoffindizes bestehen.

Im Falle einer synthetischen Replikationspolitik investiert der Teilfonds zu jeder Zeit mindestens 51 % seines Nettovermögens in Aktien und/oder Wertpapiere, die als gleichwertig mit Aktien behandelt werden, die von Unternehmen aus anderen Ländern als nicht kooperativen Ländern bei der Bekämpfung von Betrug und Steuerverhinderung ausgegeben werden. Der Rest, nämlich maximal 25 % seines Vermögens, kann in andere übertragbare Wertpapiere, in Derivate, Geldmarktinstrumente und/oder Barmittel sowie, innerhalb eines Limits von 15 % seines Nettovermögens, in Schuldverschreibungen jeglicher Art investiert werden, und innerhalb eines Limits von 10 % des Nettovermögens in OGAW und/oder UCIs.

Investoren können jeden Tag, an dem die Börsen in Paris, London, Frankfurt, New York, Tokio und Hongkong den ganzen Tag geöffnet sind und an dem Währungen in EUR, GBP und USD abgerechnet werden sollen, abonnieren oder einlösen (außer samstags und sonntags sowie an luxemburgischen und französischen Feiertagen).

Der Antrag auf ein Abonnement und Einlösung kann bis spätestens 4,00 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 aktiven Anlage in unterschiedlichen Anlageklassen, während gleichzeitig ein Erhalt des Risikoprofils zwischen vordefinierten Grenzen angestrebt wird.

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.

- 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 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	entfällt
Rücknahmeabschläge	entfällt
Kosten, die vom OGAW im Laufe eines Jahres abgezogen werden	
Laufende Kosten	0,66% (*)
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.

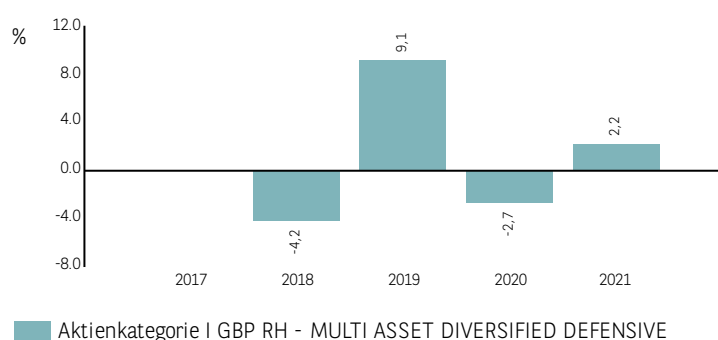
(*) Die ausgewiesenen **laufenden Kosten** basieren auf früheren Aufwendungen ermittelt zum 31. Dezember 2021.

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



- Die frühere Wertentwicklung lässt keine Rückschlüsse auf die künftige Wertentwicklung zu.
- Die Wertentwicklung wird ohne Verwaltungskosten berechnet.
- Die Aktienklasse wurde am 02. März 2017 aufgelegt.
- Die frühere Wertentwicklung wurde im Jahr GBP 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.
- 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, succursale de Zurich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zürich, erhältlich. Als Zahlstelle in der Schweiz agiert BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zürich.
- 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.

