

# 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.

## BOND EUROPE CLIMATE CARBON OFFSET PLAN, ein Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-

Klasse „I EUR Capitalisation“- ISIN-Code LU2051095011

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

### Ziele und Anlagepolitik

Der Teilfonds ist bestrebt, (i) den Wert seiner Vermögenswerte mittelfristig durch ein Engagement in einem dynamischen Korb europäischer Investment-Grade-Unternehmensanleihen zu steigern; die Bestandteile des Korbes werden mithilfe einer systematischen Auswahlmethode auf der Grundlage der Kriterien Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) sowie auf CO<sub>2</sub>-Emissions- und Energiewende-Kriterien ausgewählt; und (ii) seine CO<sub>2</sub>-Bilanz auszugleichen (Scope 1 und 2).

Um sein Anlageziel zu erreichen, implementiert der Teilfonds eine quantitative Anlagestrategie (die „Strategie“) über den BNP Paribas Bond Europe Climate Care Index TR (der „Strategieindex“). Das Anlageuniversum setzt sich aus europäischen Unternehmen zusammen, die auf der Grundlage ihres ESG-Scores, ihrer Liquiditätsbeschränkungen, Energiewende-Ratings und finanziellen Robustheit ausgewählt werden. Die Anwendung von ESG-Kriterien, insbesondere Energieeffizienz, die Wahrung der Menschen- und Arbeitnehmerrechte oder die Unabhängigkeit des Aufsichtsrats, folgt einem „Best-in-Class“- und Selektivitätsansatz, der darauf abzielt, die in ihrem Sektor führenden Unternehmen durch den Ausschluss von mindestens 20% der Wertpapiere aus dem anfänglichen Anlageuniversum auszuwählen. Der Allokationsalgorithmus folgt dann einem thematischen Investitionsansatz in einer Weise, die eine Maximierung des Energiewende-Scores des resultierenden Anleihenkorbs anstrebt, unter Berücksichtigung der Haupteinschränkungen der Risikominderung und einer CO<sub>2</sub>-Bilanz von höchstens 50 % der CO<sub>2</sub>-Bilanz eines europäischen Referenz-Anlageuniversums, während gleichzeitig die Abweichung des Portfolios von einem Portfolio, das den europäischen Investment-Grade-Anleihenmarkt repräsentiert, mit dem Ziel eines kontrollierten Tracking Error von höchstens 2 % kontrolliert wird.

Eine nicht finanzbezogene Strategie kann methodische Einschränkungen beinhalten, wie z. B. das Risiko hinsichtlich ESG-Anlagen oder das Risiko hinsichtlich einer systematischen Allokation unter Einbeziehung nicht finanzbezogener Kriterien.

Der Strategieindex basiert auf einem systematischen, von BNP Paribas entwickelten Modell und wird vierteljährlich unter Anwendung eines spezifischen Algorithmus neu gewichtet. Die Wertentwicklung des Strategieindex (und indirekt die des Teilfonds) wird durch mit der vierteljährlichen Neugewichtung verbundenen jährlichen Nachbildungskosten sowie durch Innovationsgebühren und Liquiditätskosten von 0,60 % p. a. reduziert, angewendet auf das Engagement in der Strategie (d. h., ca. 100 % des Nettoinventarwerts des Teilfonds). 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/BNPIBECC.pdf>. Ein Ausgleich der CO<sub>2</sub>-Bilanz wird von der Verwaltungsgesellschaft durch die Verwendung einer Art von CO<sub>2</sub>-Zertifikaten den VERs (Verified Emission Reductions, Emissionsminderungszertifikate) wie folgt umgesetzt: Die Verwaltungsgesellschaft berechnet die CO<sub>2</sub>-Bilanz (Scopes 1 und 2) unter Verwendung der Zusammensetzung der Basiswerte des Teilfonds, um die Anzahl der zum Ausgleich der CO<sub>2</sub>-Emissionen erforderlichen VERs zu ermitteln. Alle erworbenen VERs, mit deren Hilfe ein Ausgleich erreicht wurde, werden storniert, um den effektiven Ausgleich zu veranschaulichen. Die Liste der mit den VERs verbundenen Projekte, die von der Verwaltungsgesellschaft ausgewählt wurden, sowie ihre Beschreibung finden Sie unter: <https://docfinder.bnpparibas-am.com/api/files/4EOA58B3-05C7-4008-86CE-FDB947DD5919>.

Der Ausgleich der CO<sub>2</sub>-Bilanz kann als teilweise eingestuft werden, insoweit (i) die Verwaltungsgesellschaft Scope 3 nicht berücksichtigt; und (ii) nur die CO<sub>2</sub>-Emissionen ausgeglichen werden, die im Zusammenhang mit den Komponenten des Strategieindex stehen, und nicht die, die mit den vom Fonds gehaltenen Finanzinstrumenten zusammenhängen, für die eine synthetische Nachbildungspolitik verfolgt wird.

Der Teilfonds verfolgt eine aktive Anlagestrategie. Der Teilfonds verfügt nicht über einen Referenzwert für den Vergleich der Wertentwicklung. Die Umsetzung der Strategie erfolgt gemäß einer synthetischen Nachbildungspolitik über den Abschluss von OTC-Derivaten (einschließlich TRS) oder in Barmitteln durch die direkte Investition in den Korb aus Unternehmensanleihen, aus denen die Strategie besteht.

Anleger können an jedem Tag, an dem die Börsen in London und New York sowie das TARGET-System (Transeuropäisches automatisches Echtzeit-Brutto-Express-Abwicklungssystem) den ganzen Tag geöffnet sind (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, 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 überwiegenden Anlage in Zinsinstrumenten. Der Anleger wird darauf aufmerksam gemacht, dass eine Zinserhöhung einen Rückgang des Wertes der Anlagen in Anleihen und Schuldtiteln sowie Festzinsinstrumenten im Allgemeinen zur Folge hat.

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.

• **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.



## 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	
<b>Ausgabeaufschläge</b>	entfällt
<b>Rücknahmeabschläge</b>	entfällt
Kosten, die vom OGAW im Laufe eines Jahres abgezogen werden	
<b>Laufende Kosten</b>	0,49% (*)
Kosten, die der OGAW unter bestimmten Umständen zu tragen hat	
<b>An die Wertentwicklung des</b>	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 Verwaltungsgesellschaft verwendet einen Teil der Verwaltungsgebühren, um die CO2-Bilanz des Teilfonds auszugleichen.

(\*) Bei den hier ausgewiesenen laufenden Kosten handelt es sich um eine Kostenschätzung. Aufgrund kürzlicher Änderungen der Gebührenstruktur wird eine Schätzung anstelle der Ex-Post-Daten verwendet.

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

- Deswegen sind noch keine ausreichenden Daten vorhanden, um den Anlegern nützliche Angaben über die frühere Wertentwicklung zu machen.
- Die Aktienklasse wurde am 15 April 2021 aufgelegt.

## Praktische Informationen

- Depotbank: BNP PARIBAS, 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 90007 - 92729 Nanterre Cedex.
- 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, 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 28 Oktober 2022.

