

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 US FACTOR DEFENSIVE, ein Teilfonds der SICAV THEAM QUANT-

Klasse „I EUR RH EUR Capitalisation“- ISIN-Code LU2051093156

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

Ziele und Anlagepolitik

Ziel des Teilfonds ist es, Kapitalwachstum zu erzielen (i) durch die Exposition gegenüber einem Korb von US-Aktien und (ii) durch die Implementierung einer systematischen Optionsstrategie, die darauf abzielt, das Risiko durch die Minimierung der Volatilität im Teilfonds zu verringern.

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

(A) ein langfristiges Engagement in einem Korb von US-Aktien über den BNP Paribas DEFI Equity US Long Net TR Index (der Strategy Index). Das Anlageuniversum des Strategy Index setzt sich aus den größten Kapitalmarktkapitalisierungen der US-Märkte zusammen, die zufriedenstellende Liquiditätsbedingungen bieten. Der Strategy Index zielt darauf ab, Aktien nach einem systematischen und quantitativen Anlageprozess auszuwählen.

Und (b) eine ergänzende systematische Optionsstrategie auf dem S&P 500 Index, die das Risiko-Rendite-Verhältnis im Vergleich zu einer Direktinvestition in den Strategy Index verbessern sollte, indem sie Long-Positionen auf Put-Optionen auf dem S&P 500 Index einnimmt, die so weit wie möglich durch die Übernahme von Short-Positionen auf Abruf finanziert wurden Optionen auf dem S&P 500-Index. Die Put-Optionsstrategie ist besonders in sehr pessimistischen Märkten angebracht, da sie es dem Subfonds ermöglicht, die Auswirkungen der fallenden US-Aktienmärkte zu begrenzen und damit seine Volatilität zu begrenzen. Die Call-Options-Strategie ist besonders in stabilen oder relativ richtungslosen Märkten angebracht.

Der Strategy Index basiert auf einem systematischen Investmentprozess, der von BNP Paribas entwickelt wurde und wird jeden Monat mithilfe eines spezifischen Algorithmus neu ausgeglichen, der (i) darauf abzielt, Aktien durch eine Kombination von vier Performancefaktoren auszuwählen: Wert, Qualität, Momentum und geringe Volatilität sowie (ii) um von einer solchen Diversifizierung der Anlage zu profitieren und (iii) um ein Beta in der Nähe von 1 und einen Ex-ante-Tracking-Fehler unter 3,5 % zu halten, d. h. um eine Performance-korrelierte Performance in Bezug auf den S&P 500 Total Return Index (Bloomberg-Code: SPTR Index).

Die vollständige Aufschlüsselung des Strategy Index ist auf der Website unter <https://indx.bnpparibas.com> verfügbar. Die Indexberechnungsmethode ist direkt unter <https://indx.bnpparibas.com/nr/DFUTTR.pdf> verfügbar.

Das Erreichen einer Performance, die mit der Performance des S&P 500 Total Return Index korreliert, kann vom Strategy Index verlangen, Leverage durch ein zusätzliches Long- oder Short-Engagement in Futures zu nutzen. Es ist zu beachten, dass im Regelbuch des Strategy Index die Kosten für die Replikation und den Neuausgleich des Strategy Index aufgeführt sind.

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 implementiert. Die Synthetic Replication Policy impliziert, dass der Sub-Fund nicht die der Strategie zugrunde liegenden Wertpapiere hält, sondern sich stattdessen auf OTC-Derivate verlässt, um seine Performance zu erzielen. Der Teilfonds investiert zu jeder Zeit mindestens 51 % seines Nettovermögens in Aktien und/oder Wertpapiere, die als gleichwertig mit Aktien behandelt werden, die von Unternehmen eines Landes ausgegeben werden.

Investoren können jeden Tag, an dem die New Yorker Börse den ganzen Tag geöffnet ist, 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.



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 | 0,80% (*) |
| 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.

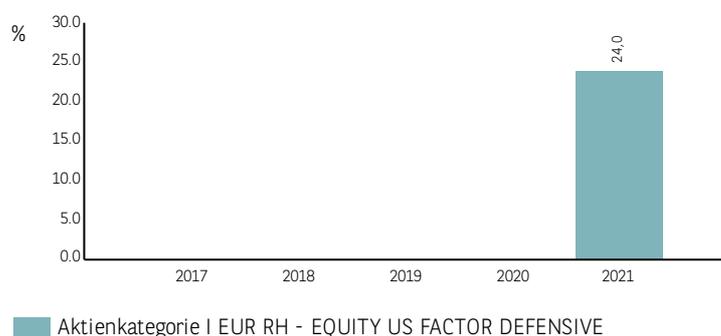
(*) Die ausgewiesenen **laufenden Kosten** basieren auf früheren Aufwendungen ermittelt zum 31. Dezember 2021.

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 18. Dezember 2020 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.

