

ZWECK

Dieses Informationsblatt stellt Ihnen wesentliche Informationen über dieses Anlageprodukt zur Verfügung. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen dabei zu helfen, die Art, das Risiko, die Kosten sowie die möglichen Gewinne und Verluste dieses Produkts zu verstehen, und Ihnen dabei zu helfen, es mit anderen Produkten zu vergleichen.

PRODUKT

FIXED INCOME DIVERSIFIER, ein Teilfonds von THEAM QUANT-, Anteilsklasse: C Capitalisation (LU2051084080)

Hersteller: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe („BNPP AM“)

Website: <https://www.bnpparibas-am.com>

Telefonnummer: weitere Informationen erhalten Sie unter der Telefonnummer +33 1 58 97 13 09.

Die Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) ist für die Überwachung des Produkts verantwortlich. BNPP AM ist in Frankreich zugelassen und wird von der Autorité des Marchés Financiers („AMF“) reguliert.

Datum der Erstellung dieses Dokuments: 01.03.2024

UM WELCHE ART VON PRODUKT HANDELT ES SICH?

Art

Dieses Produkt ist ein Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren (OGAW). Es ist ein Teilfonds von THEAM QUANT-, einer offenen Investmentgesellschaft (Société d'Investissement à Capital variable, „SICAV“), die den Bestimmungen von Teil I des Gesetzes von 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen sowie der OGAW-Richtlinie 2009/65 unterliegt.

Laufzeit

Dieses Produkt hat kein Fälligkeitsdatum.

BNPP AM ist nicht berechtigt, das Produkt einseitig zu kündigen. Der Verwaltungsrat ist befugt, über die Zusammenlegung, Aufteilung, Liquidation oder Schließung des Teilfonds zu entscheiden. Darüber hinaus kann die SICAV durch Beschluss einer außerordentlichen Hauptversammlung der Anteilhaber aufgelöst werden.

Ziele

Ziel des Teilfonds ist die mittelfristige Wertsteigerung der Vermögenswerte durch ein Engagement in einem globalen, dynamischen Long-/Short-Portfolio aus kurzfristigen Geldmarktsätzen und langfristigen Staatsanleihen. Der Aufbau des Portfolios erfolgt mithilfe einer systematischen Auswahl von diversifizierten Renditequellen an den Zinsmärkten mit dem Ziel, (i) die jährliche Volatilität des Teilfonds auf einem Zielniveau von 4,5 % zu halten und (ii) mittelfristig Marktneutralität beim Engagement in Staatsanleihen zu erreichen.

Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der Teilfonds eine in Euro abgesicherte quantitative Anlagestrategie (die Strategie) um, die sich auf zwei Säulen der Wertentwicklung stützt:

(a) ein Long-/Short-Portfolio aus Geldmarktinstrumenten (das kurzfristige Portfolio), das darauf ausgerichtet ist, Trends bei den kurzfristigen Zinssätzen zu erkennen und zu monetarisieren, indem Long- oder Short-Engagements in EUR- und USD-Futures auf kurzfristige Zinssätze eingegangen werden.

(b) ein Long-/Short-Portfolio aus langfristigen Staatsanleihen (das Anleiheportfolio), das darauf abzielt, diversifizierte Ertragsquellen, die sich aus Marktchancen oder Ineffizienzen auf dem gesamten Zinsmarkt ergeben, zu identifizieren und zu erfassen. Das Anleiheportfolio ist insbesondere in drei Performance-Faktoren engagiert: Carry, Dynamik und Relative Value. Das Engagement erfolgt über Strategien, die Long- und Short-Positionen in langfristigen Futures auf weltweite Staatsanleihen eingehen, vorwiegend aus Europa, Nordamerika und Japan, wobei das Engagement zwischen -150 % und 150 % je Futures-Kontrakt liegt.

Innerhalb der einzelnen Strategien wird durch die Anwendung eines systematischen Risiko-Rendite-Optimierungsmodells eine automatische Umschichtung durchgeführt, wobei mittelfristig eine insgesamt neutrale Sensitivität gegenüber dem Anleihemarkt angestrebt 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 (einschließlich TRS) umgesetzt.

Anleger können an jedem Tag, an dem die Börsen in Frankreich, Deutschland, dem Vereinigten Königreich, Japan, Kanada und den USA den ganzen Tag geöffnet sind und an dem EUR und USD abgerechnet werden (außer samstags und sonntags sowie an luxemburgischen und französischen Feiertagen), Anteile zeichnen oder zurückgeben.

Zeichnungs- und Rücknahmeanträge können vor 16:00 Uhr (MEZ) am Geschäftstag vor dem 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.

Kleinanleger-Zielgruppe

Dieses Produkt ist für Anleger konzipiert, die über eine gewisse Finanzexpertise und/oder durchschnittliche Kenntnisse verfügen, um das Produkt zu verstehen, und die einen vollständigen Kapitalverlust verkraften können. Es ist für Kunden geeignet, die Kapitalwachstum anstreben. Potenzielle Anleger sollten einen Anlagehorizont von mindestens 3 Jahren haben.

Praktische Informationen

■ Verwahrstelle: BNP PARIBAS, Luxembourg Branch

■ Dieses Basisinformationsblatt wurde für die oben genannte Anteilsklasse erstellt und beschreibt einen Teilfonds des THEAM QUANT- Fonds. Weitere Informationen über das Produkt sind im Prospekt und in den regelmäßigen Berichten enthalten, die auf der Ebene der SICAV herausgegeben werden. Nach luxemburgischem Recht haften die Teilfonds getrennt voneinander, d. h. die Vermögenswerte eines Teilfonds können nicht dazu verwendet werden, die Ansprüche eines Gläubigers oder einer dritten Partei gegenüber einem anderen Teilfonds zu erfüllen.

■ Anleger können Anteile zwischen den Teilfonds der SICAVs umschichten. Einzelheiten hierzu erfahren Sie im Verkaufsprospekt oder von Ihrem Finanzberater.

■ Weitere Informationen zum Produkt, einschließlich des aktuellen Verkaufsprospekts, des Basisinformationsblatts, der Nettoinventarwerte, der zuletzt veröffentlichten Anteilspreise, des Jahresberichts und der Anlagebeschreibung, sind kostenlos erhältlich bei BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Customer Service - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, Frankreich.



WELCHE RISIKEN BESTEHEN UND WAS KÖNNTE ICH IM GEGENZUG DAFÜR BEKOMMEN?

Risikoindikator



Der Risikoindikator beruht auf der Annahme, dass Sie das Produkt 3 Jahre halten.

Der Gesamtrisikoindikator dient als Anhaltspunkt für das mit diesem Produkt verbundene Risiko im Vergleich zu anderen Produkten. Er zeigt, wie hoch die Wahrscheinlichkeit ist, dass Sie bei diesem Produkt Geld verlieren, aufgrund von Marktbewegungen oder weil wir nicht in der Lage sind, Sie auszubezahlen.

Wir haben dieses Produkt auf einer Skala von 1 bis 7 in die Risikoklasse 3 eingestuft, was eine Risikoklasse zwischen niedrig und mittel ist. 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.

Bitte beachten Sie das Währungsrisiko. Wenn die Währung Ihres Kontos von der Währung dieses Produkts abweicht, hängen die Zahlungen, die Sie erhalten, vom Wechselkurs zwischen den beiden Währungen ab. Dieses Risiko ist bei dem oben angegebenen Indikator nicht berücksichtigt.

Sonstige, für das Produkt wesentliche Risiken, die nicht im Gesamtrisikoindikator enthalten sind:

- **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 mit ihm verbundenen Finanzinstrumente führen kann.
- **Risiko im Zusammenhang mit dem Einsatz von Finanztermininstrumenten:** Diese Instrumente können mit einer Reihe von Risiken verbunden sein, die sich auf den Nettoinventarwert auswirken können.

Weitere Einzelheiten zu den Risiken finden Sie im Verkaufsprospekt.

Dieses Produkt beinhaltet keinen Schutz vor künftigen Marktentwicklungen, sodass Sie das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren könnten.

PERFORMANCE-SZENARIEN

In den angeführten Zahlen sind sämtliche Kosten des Produkts selbst enthalten, jedoch unter Umständen nicht alle Kosten, die Sie an Ihren Berater oder Ihre Vertriebsstelle zahlen müssen. Unberücksichtigt ist auch Ihre persönliche steuerliche Situation, die sich ebenfalls auf den am Ende erzielten Betrag auswirken kann. Was Sie bei diesem Produkt am Ende herausbekommen, hängt von der künftigen Marktentwicklung ab. Die künftige Marktentwicklung ist ungewiss und lässt sich nicht mit Bestimmtheit vorhersagen. Die dargestellten ungünstigen, mittleren und günstigen Szenarien stellen Beispiele dar, die die beste und schlechteste Performance sowie die durchschnittliche Performance des Produkts und/oder der entsprechenden Benchmark über die letzten 10 Jahre verwenden. Die Märkte könnten sich künftig völlig anders entwickeln. Das Stressszenario zeigt, was Sie unter extremen Marktbedingungen zurückbekommen könnten.

Empfohlene Haltedauer: 3 Jahre Anlagebeispiel: 10.000 EUR	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	Wenn Sie nach 3 Jahren aussteigen
Szenarien		
Minimum	Es gibt keine garantierte Mindestrendite. Sie könnten das angelegte Kapital ganz oder teilweise verlieren.	
Stressszenario	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	6.545,27 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-34,55%
Pessimistisches	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	7.100,21 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-10,79%
Mittleres	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	8.835,79 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-11,64%
Optimistisches	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	9.063,44 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-3,22%
	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	9.946,62 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-0,53%
	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	10.427,07 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	1,40%
	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	10.683,9 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	6,84%
	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	11.444,12 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	4,60%

Die nachstehenden Szenarien ergaben sich bei einer Anlage unter Verwendung eines geeigneten Stellvertreters. Das optimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 2017 und 2020.

Das mittlere Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 2014 und 2017.

Das pessimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 2018 und 2021.

WAS GESCHIEHT, WENN BNPP AM NICHT IN DER LAGE IST, DIE AUSZAHLUNG VORZUNEHMEN?

Die SICAV besteht als eigenständige, von BNPP AM getrennte Einheit.

Bei einem Ausfall von BNPP AM bleiben die von einer Depotbank gehaltenen Vermögenswerte der SICAV unberührt.

Bei einem Ausfall der Depotbank wird das Risiko eines finanziellen Verlusts der SICAV aufgrund der rechtlichen Trennung der Vermögenswerte der Verwahrstelle von denen des Produkts / der SICAV gemindert.

WELCHE KOSTEN ENTSTEHEN?

Die Person, die Ihnen dieses Produkt verkauft oder Sie dazu berät, kann Ihnen weitere Kosten berechnen. Sollte dies der Fall sein, teilt diese Person Ihnen diese Kosten mit und legt dar, wie sich diese Kosten auf Ihre Anlage auswirken werden.

Kosten im Zeitverlauf

In den Tabellen werden Beträge dargestellt, die zur Deckung verschiedener Kostenarten von Ihrer Anlage entnommen werden. Diese Beträge hängen davon ab, wie viel Sie anlegen und wie lange Sie das Produkt halten. Bei den hier dargestellten Beträgen handelt es sich um Veranschaulichungen, die auf einem Beispielanlagebetrag und unterschiedlichen möglichen Anlagezeiträumen basieren.

Wir haben angenommen:

- Im ersten Jahr würden Sie den angelegten Betrag zurückerhalten (0% Jahresrendite). Für die anderen Halteperioden haben wir angenommen, dass sich das Produkt wie im mittleren Szenario dargestellt entwickelt.



■ 10.000 EUR investiert wird.

	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	Wenn Sie nach 3 Jahren aussteigen
Kosten insgesamt	456,49 EUR	812,85 EUR
Jährliche Kostenauswirkung (*)	4,61%	2,69% pro Jahr

(*) Diese Angaben veranschaulichen, wie die Kosten Ihre Rendite pro Jahr während der Haltedauer verringern. Wenn Sie beispielsweise zum Ende der empfohlenen Haltedauer aussteigen, wird Ihre durchschnittliche Rendite pro Jahr voraussichtlich 4,09% vor Kosten und 1,40% nach Kosten betragen.

Zusammensetzung der Kosten

Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	
Einstiegskosten	Bis zu 3,00% des Betrages, den Sie beim Einstieg in diese Anlage zahlen.	Bis zu 300 EUR
Ausstiegskosten	Wir berechnen keinen Rücknahmeabschlag.	0 EUR
Laufende Kosten [pro Jahr]		
Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten	0,92% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Der Prozentsatz der laufenden Gebühren basiert auf den am 31.12.2023 berechneten früheren Aufwendungen.	89,24 EUR
Transaktionskosten	0,69% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Dieser Prozentsatz stellt den Wert Ihrer Anlage pro Jahr dar. Hierbei handelt es sich um eine Schätzung der Kosten, die anfallen, wenn wir die zugrunde liegenden Anlagen für das Produkt kaufen oder verkaufen. Der tatsächliche Betrag hängt davon ab, wie viel wir kaufen und verkaufen.	67,25 EUR
Zusätzliche Kosten unter bestimmten Bedingungen		
Erfolgsgebühren	Für dieses Produkt fällt keine Erfolgsgebühr an.	0 EUR

Bei einem Umtausch kann Anlegern eine Gebühr von maximal 1,50% berechnet werden.

WIE LANGE SOLLTE ICH DIE ANLAGE HALTEN, UND KANN ICH VORZEITIG GELD ENTFEHNEN?

Empfohlene Haltedauer („RHP“): 3 Jahre.

Die empfohlene Haltedauer wurde auf der Grundlage des Risiko- und Renditeprofils des Produkts festgelegt.

Anleger können ihre Anteile täglich (an Bankarbeitstagen) anweisen und der Rücknahmeauftrag wird gemäß dem im Prospekt beschriebenen Kalender ausgeführt. Jede Rücknahme, die vor Ablauf der empfohlenen Haltedauer erfolgt, kann sich negativ auf das Performance-Profil des PRIIP auswirken.

WIE KANN ICH MICH BESCHWEREN?

Bei Beschwerden sollten sich Anleger an ihren zuständigen Berater bei dem Institut wenden, das das Produkt empfohlen hat. Sie können sich auch über die Website www.bnpparibas-am.fr (Rubrik footer-complaints-management-policy in der Fußzeile) an BNPP AM wenden oder ein Einschreiben mit Rückschein an BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Client Service - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, Frankreich, oder per E-Mail an amfr.reclamations@bnpparibas.com senden.

SONSTIGE ZWECKDIENLICHE ANGABEN

■ Um auf die früheren Wertentwicklungen des Produkts zuzugreifen, befolgen Sie bitte die nachstehenden Anweisungen:

(1) Gehen Sie auf <https://www.bnpparibas-am.fr>. (2) Behalten Sie auf der Willkommenseite das Land „Frankreich“, wählen Sie die Sprache und Ihr Anlegerprofil aus. Akzeptieren Sie die Geschäftsbedingungen der Website. (3) Gehen Sie zur Registerkarte „FUNDS“ und dann zu „Funds Explorer“. (4) Suchen Sie das Produkt anhand des ISIN-Codes oder des Produktnamens und klicken Sie auf das Produkt. (5) Klicken Sie auf die Registerkarte „Performance“.

■ Dieses Diagramm auf der Website zeigt die Wertentwicklung des Fonds als prozentualen Verlust oder Gewinn pro Jahr über die letzten 4 Jahre.

