

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

Equity Europe Dynamic Factor Defensive, ein Teilfonds von THEAM QUANT-, Anteilsklasse: I Capitalisation (LU1685632132)

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: 31.07.2026

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 Anteilinhaber aufgelöst werden.

Ziele

Das Ziel des Teilfonds ist die Erwirtschaftung von Kapitalzuwachs. Dies geschieht (i) durch ein Engagement in einem Korb aus europäischen Aktien unter Berücksichtigung nicht finanzbezogener Kriterien und (ii) durch die Umsetzung einer systematischen Optionsstrategie, deren Ziel die Verminderung des Risikos ist, indem die Volatilität des Teilfonds auf ein Minimum reduziert wird.

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

(a) ein Long-Engagement in einem Korb europäischer Aktien auf der Grundlage eines Faktorauswahlansatzes (das „optimale Portfolio“), der sich auf ein systematisches und quantitatives Anlageverfahren stützt; und

(b) eine ergänzende systematische Optionsstrategie auf einen oder mehrere der wichtigsten europäischen Aktienindizes, die das Risiko-Rendite-Verhältnis im Vergleich zu einer direkten Anlage im optimalen Portfolio verbessern soll, indem Long-Positionen in Put-Optionen auf diese Indizes eingegangen werden in Kombination mit einem Take-Profit-Mechanismus auf diese Put-Optionen, wobei die Finanzierung, soweit möglich, durch Eingehen von Short-Positionen auf Call-Optionen auf dieselben Indizes erfolgt. Die Put-Optionen-Strategie ist vor allem in ausgeprägten Baissemärkten angemessen, da sie es dem Teilfonds ermöglicht, die Auswirkungen fallender europäischer Aktienmärkte und somit seine Volatilität zu begrenzen. Die Call-Optionen-Strategie ist vor allem in stabilen oder ziemlich richtungslosen Märkten sinnvoll. Eine zusätzliche dynamische Allokation zwischen den europäischen Aktienindizes und dem optimalen Portfolio ermöglicht es, mögliche Divergenzen abzumildern.

Das Ziel des Modells, das für den Aufbau des optimalen Portfolios verwendet wird, basiert insbesondere auf einem Faktorauswahlansatz. Das Ziel eines solchen Faktoransatzes ist der Aufbau eines Portfolios, um eine Überrendite gegenüber traditionellen Marktkapitalisierungsreferenzindizes zu erzielen, (i) indem es in diversifizierten Wertentwicklungsfaktoren engagiert ist und (ii) einen Allokationsmechanismus implementiert, der darauf abzielt, das relative Risiko zwischen diesen Wertentwicklungsfaktoren gegenüber ihrem Referenzmarkt zu kontrollieren.

Das zum Aufbau eines solchen optimalen Portfolios verwendete Modell besteht insbesondere aus folgenden Schritten:

(a) Festlegung des anfänglichen Universums (das „Referenzportfolio“), das sich aus einem breiten und repräsentativen Korb europäischer Aktien zusammensetzt;

(b) Festlegung des optimalen Portfolios über einen Optimierungsalgorithmus mit dem Ziel, Aktien durch die Verwendung mehrerer fundamentaler Indikatoren auszuwählen, um zu bestimmen, auf welche Anlagestile sich die Strategie konzentrieren soll. Die Auswahl auf der Grundlage von Anlagestilen besteht darin, Unternehmen mit dem besser eingestuften Merkmal in Bezug auf einen bestimmten Faktor auszuwählen: z. B. attraktive Bewertung zum Wert, bewährtes Geschäftsmodell für Qualität, positiver Trend für Dynamik und geringes Risikoprofil, d. h. stetiges Tempo für niedrige Volatilität. Die Optimierung erfolgt insbesondere gemäß den Haupteinschränkungen wie branchenspezifische Diversifizierung, Liquidität und Wertentwicklung in Korrelation mit der des europäischen Referenzmarkts.

Die Umsetzung des optimalen Portfolios erfolgt über den BNP Paribas Dynamic Equity Factors Europe ESG Index. Er basiert auf einem quantitativen, von BNP Paribas entwickelten Modell und wird monatlich unter Anwendung eines spezifischen Algorithmus neu gewichtet. Anleger sollten beachten, dass mit der monatlichen Neuanpassung jedes Portfolios verbundene jährliche Nachbildungskosten und Liquiditätskosten anfallen (diese Kosten können sich abhängig von den Marktbedingungen ändern). Diese Kosten verringern die Wertentwicklung eines solchen Index und indirekt die Wertentwicklung des Teilfonds.

Weitere Informationen über einen solchen Index, seine Zusammensetzung, Berechnung und die Regeln für die Überwachung und die regelmäßige Neugewichtung finden Sie unter <https://docfinder.bnpparibas-am.com/api/files/dce4be0a-f58f-4a1c-8939-e8f5bac0b9cd>.

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 nicht tatsächlich die zugrunde liegenden Wertpapiere der Strategie hält, sondern stattdessen OTC-Derivate verwendet, um ihre Wertentwicklung zu erzielen. Der Teilfonds investiert immer mindestens 75 % seines Nettovermögens in Aktien, die von Unternehmen begeben werden, die ihren eingetragenen Sitz in einem Mitgliedsstaat des Europäischen Wirtschaftsraums haben.

Anleger können an jedem Tag, an dem die Börsen in Frankreich, Großbritannien, Deutschland, Schweden, Italien, der Schweiz, Norwegen und Dänemark 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.



Kleinanleger-Zielgruppe

Dieses Produkt ist für Anleger konzipiert, die weder über Finanzexpertise noch über spezifische Kenntnisse verfügen, um das Produkt zu verstehen, aber dennoch einen vollständigen Kapitalverlust verkraften können. Es ist für Kunden geeignet, die Kapitalwachstum anstreben. Potenzielle Anleger sollten einen Anlagehorizont von mindestens 5 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 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 Anlage in einer Aktienstrategie, die darauf abzielt, das Risiko und die Volatilität zu reduzieren, die mit Aktien verbunden sind.

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.
- 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: 5 Jahre	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	Wenn Sie nach 5 Jahren aussteigen
Anlagebeispiel: 10.000 EUR		

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	6.456,89 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-35,43%
Pessimistisches	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	8.673,76 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	-13,26%
Mittleres	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	10.741,94 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	7,42%
Optimistisches	Was Sie am Ende nach Abzug der Kosten	12.796,13 EUR
	Jährliche Durchschnittsrendite	27,96%

Die nachstehenden Szenarien ergaben sich bei einer Anlage unter Verwendung eines geeigneten Stellvertreters. Das optimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 2016 und 2021.

Das mittlere Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 2021 und 2026.

Das pessimistische Szenario ergab sich bei einer Anlage zwischen 2025 und 2026.

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 5 Jahren aussteigen
Kosten insgesamt	126 EUR	885,6 EUR
Jährliche Kostenauswirkung (*)	1,26%	1,34% 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 7,85% vor Kosten und 6,51% nach Kosten betragen.

Zusammensetzung der Kosten

Einmalige Kosten bei Einstieg oder Ausstieg	Wenn Sie nach 1 Jahr aussteigen	
Einstiegskosten	Wir berechnen keinen Ausgabeaufschlag.	0 EUR
Ausstiegskosten	Wir berechnen keinen Rücknahmeabschlag.	0 EUR
Laufende Kosten [pro Jahr]		
Verwaltungsgebühren und sonstige Verwaltungs- oder Betriebskosten	0,80% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. Der Prozentsatz der laufenden Gebühren basiert auf den am 31.12.2025 berechneten früheren Aufwendungen.	80 EUR
Transaktionskosten	0,46% des Werts Ihrer Anlage pro Jahr. 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 kann variieren. Diese Zahl ist daher indikativ und kann nach oben oder nach unten korrigiert werden.	46 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 ENTNEHMEN?

Empfohlene Haltedauer („RHP“): 5 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. Das Produkt hat ein Aktienrücknahmeobergrenze-System, das es ermöglicht, Rücknahmeanträge unter außergewöhnlichen Umständen und gemäß den im Prospekt des Produkts dargelegten Bedingungen aufzuschieben.

WIE KANN ICH MICH BESCHWEREN?

Bei Beschwerden sollten sich Anleger an ihren zuständigen Berater bei dem Institut wenden, dass 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 6 Jahre.

