

## THEAM QUANT MULTI ASSET DIVERSIFIED Privilege Capitalisation / LU1353184184 / A2N91R / BNP PARIBAS AM Eur.

Aktuell 20.08.2025 <sup>1</sup>	Region	Branche			Ausschüttungsart		Тур				
70,52 EUR	weltweit	Al Hedgefonds Single Strategy			thesaurierend		Alternative Investm.				
	tata				25%	Risikokennzahlen					
					20%	SRI	1	2 3	4	5	6 7
4/4.1				15%	Jahresperformand	е					
MY MY		A PHINA	MAN A A		10%	2024					4,97%
4/4		har all all all		Many	5%	2023				-;	5,44%
					-5%	2022				-(	0,83%
					-10%	2021				+(	0,44%
					-15%	2020				-	7,39%
2021 202	2 202	23 20	024	2025							

Performanceergebnisse der Vergangenheit lassen keine Rückschlüsse auf die künftige Entwicklung zu.

Stammdaten		
Fondart	Einzelfond	
Kategorie	Alternative Investments	
Fondsunterkategorie	Al Hedgefonds Single Strategy	
Ursprungsland	Luxemburg	
Tranchenvolumen	(20.08.2025) EUR 39626,670	
Gesamt-Fondsvolumen	(20.08.2025) EUR 21,95 Mio.	
Auflagedatum	13.11.2017	
KESt-Meldefonds	Nein	
Beginn des Geschäftsjahres	01.01.	
Nachhaltigkeitsfondsart	-	
Fondsmanager	Solene Deharbonnier	
Thema	-	

Konditionen	
Ausgabeaufschlag	3,00%
Managementgebühr	0,70%
Depotgebühr	-
Tilgungsgebühr	0,00%
Sonstige lfd. Kosten	(14.03.2025) 1,01%
Transaktionskosten	0,54%

Sonstige Kennzahlen	
Mindestveranlagung	EUR 1.000.000,00
Sparplan	Nein
UCITS / OGAW	Ja
Gewinnbeteiligung	0,00%
Umschichtgebühr	1,50%
Fondsgesellschaft	

BNP PARIBAS AM Eur. 14 rue Bergère, 75009, Paris Frankreich

https://www.bnpparibas-am.com

Performance	1M	6M	YTD	<b>1</b> J	2J	3J	5J	seit Beginn
Performance	+1,29%	-9,23%	-8,44%	-8,71%	-14,95%	-26,94%	-12,47%	-29,00%
Performance p.a.	-	-	-	-8,71%	-7,78%	-9,94%	-2,63%	-4,31%
Performance p.a. nach max. AGA	+1,29%	-9,23%	-8,44%	-8,71%	-7,78%	-9,94%	-2,63%	-4,31%
Sharpe Ratio	1,56	-1,68	-1,32	-1,04	-0,92	-1,13	-0,45	-0,63
Volatilität	9,55%	11,79%	11,36%	10,29%	10,66%	10,59%	10,39%	10,10%
Schlechtester Monat	-	-6,74%	-6,74%	-6,74%	-6,74%	-7,40%	-7,40%	-7,40%
Bester Monat	-	+3,07%	+3,07%	+3,07%	+5,11%	+5,11%	+8,47%	+8,47%
Maximaler Verlust	-3,55%	-14,15%	-14,73%	-16,66%	-21,75%	-33,27%	-33,48%	-36,80%

# Vertriebszulassung

Österreich, Deutschland, Schweiz, Tschechien;

<sup>1.</sup> Wichtiger Hinweis zum Aktualisierungsstand: Das angegebene Datum bezieht sich ausschließlich auf die Berechnung des NAV.



### THEAM QUANT MULTI ASSET DIVERSIFIED Privilege Capitalisation / LU1353184184 / A2N91R / BNP PARIBAS AM Eur.

## Investmentstrategie

Das Anlageuniversum der Strategie setzt sich aus vier Anlageklassen zusammen: (i) Aktien, (ii) festverzinsliche Anlagen einschließlich Schuldtitel, (iii) Währungen und (iv) Rohstoffindizes. Der zur Auswahl der Basiswerte aus den einzelnen Anlageklassen verwendete Prozess basiert auf Kriterien in Zusammenhang mit geografischer Diversifizierung, Liquidität und Transparenz. Es wird täglich eine automatische Umschichtung zwischen den verschiedenen Basiswerten mithilfe eines Algorithmus vorgenommen. Eine optimale Diversifizierung wird über die Anwendung eines systematischen Risiko-Rendite-Optimierungsmodells angestrebt, das auf historisch beobachteten Niveaus basiert (Wertentwicklung, Volatilität und Korrelation). Die Umsetzung der Strategie erfolgt über den Finanzindex (der Strategieindex) BNP Paribas Cross Asset Trend Vol 10% (Bloomberg-Code: BNPICT10 Index) Der Strategieindex beruht auf einem systematischen, von BNP Paribas entwickelten Modell. Er wird bis zu einmal täglich über technische Anpassungen mittels systematischer Algorithmen neu gewichtet. Diese Methodik berücksichtigt bestimmte Gebühren, die die Nachbildung, Neugewichtung und Fixkosten abdecken.

#### Fondsspezifische Informationen

Im Rahmen der Anlagestrategie kann in wesentlichem Umfang in Derivate investiert werden. Die Fondsbestimmungen des THEAM QUANT MULTI ASSET DIVERSIFIED Privilege Capitalisation wurden durch die FMA bewilligt. Der THEAM QUANT MULTI ASSET DIVERSIFIED Privilege Capitalisation kann mehr als 35 % des Fondsvermögens in Wertpapiere/Geldmarktinstrumente folgender Emittenten investieren: by an EU Member State or its local authorities, by another OECD Member State, by certain non-OECD Member State (currently Brazil, Indonesia, Russia and South Africa) or by public international organisations in which one or more EU Member States are members..

### Investmentziel

Ziel des Teilfonds ist es, den Wert seiner Vermögenswerte mittelfristig durch ein Engagement in einem in Euro abgesicherten diversifizierten Korb aus Long/Short-Positionen zu steigern, dessen Komponenten mithilfe einer systematischen Auswahlmethode ausgewählt werden, die auf verschiedenen Anlageklassen basiert. Das Engagement in dem dynamischen Korb ist angepasst, um die jährliche Volatilität des Teilfonds auf einem Zielniveau von 10 % zu halten.

### Veranlagungsstruktur



<u>4</u>0

80

100

80

100