

Datos fundamentales para el inversor

El presente documento proporciona datos fundamentales para los inversores de este subfondo. No se trata de material de promoción comercial. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del subfondo y los riesgos que comporta invertir en él. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él.

MULTI ASSET DIVERSIFIED, un subfondo de la SICAV THEAM QUANT-

Clase «I EUR Capitalisation» - Código ISIN LU1353185074

Este Subfondo está gestionado por BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, sociedad del Grupo BNP Paribas.

Objetivos y política de inversión

El objetivo del Subfondo es aumentar el valor de sus activos a medio plazo, exponiéndose a una cesta diversificada de valores a largo/corto plazo, cubiertos en euros, cuyos componentes se escogen utilizando un método de selección sistemática según distintas clases de activos. La exposición a la cesta dinámica se adaptará para mantener la volatilidad anual del Subfondo en un nivel objetivo del 10

El universo de inversión de la estrategia se compone de cuatro clases de activos: (i) valores de renta variable; (ii) renta fija, lo que incluye crédito; (iii) divisas, y (iv) materias primas. El proceso utilizado para seleccionar el subyacente de cada clase de activo se basa en criterios relacionados con la diversificación geográfica, la liquidez y la transparencia.

Diariamente, se lleva a cabo una reasignación automática entre los diferentes subyacentes. Para ello, se utiliza un algoritmo. Se buscará la diversificación óptima mediante la aplicación de un modelo sistemático de optimización de riesgo/rendimiento según los niveles observados históricamente (rendimiento, volatilidad y correlación).

La estrategia se implementa mediante el uso del índice financiero (el Índice de la Estrategia) BNP Paribas Cross Asset Trend Vol 10% (código de Bloomberg: BNPICT10 Index). El Índice de la Estrategia se basa en un modelo sistemático desarrollado por BNP Paribas y su frecuencia de reequilibrio, que corresponde a ajustes técnicos basados en algoritmos sistemáticos, puede ser diaria. La metodología incorpora ciertas tasas que cubren la replicación, el reequilibrio y los costes fijos. Los costes de replicación y reequilibrio suponen, en promedio y de forma aproximada, un 2,3anual. La tasa fija se establece en un 0,5anual. Para obtener más información sobre el Índice de la Estrategia, se invita a los inversores a consultar el siguiente sitio web: <https://indx.bnpparibas.com>. El desglose completo de este índice y la información de rendimiento están disponibles en el mismo sitio web. El método de cálculo del índice está disponible directamente en: <https://indx.bnpparibas.com/nr/CT10ER.pdf>.

La Estrategia del Subfondo se considera activa. El Subfondo no tiene ningún índice de referencia para fines de comparación del rendimiento.

La Estrategia se implementa de acuerdo con una Política de replicación sintética a través de la conclusión de derivados extrabursátiles. La Política de replicación sintética implica que el Subfondo no posee realmente los valores subyacentes del índice, sino que se basa en derivados extrabursátiles para obtener el rendimiento de la Estrategia. El Subfondo invierte en todo momento al menos el 75de su patrimonio neto en renta variable emitida por empresas que tengan su domicilio social en un Estado miembro del Espacio Económico Europeo.

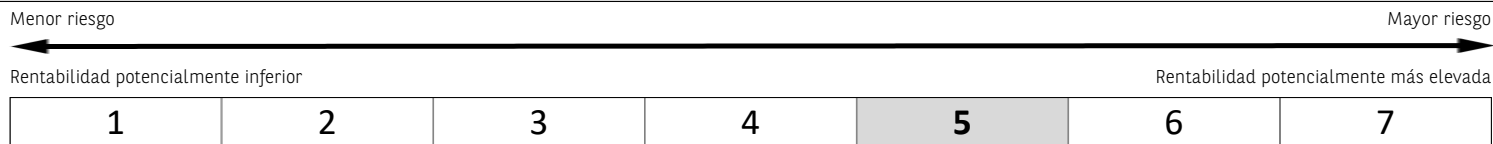
Los inversores pueden suscribirse o reembolsar cualquier día en que las bolsas de Francia, Alemania, ReinoSuecia, Suiza, EstadosCanadá, Brasil, Japón, Taiwán, Corea del Sur, Hongy Australia estén abiertas durante todo el día y en que las monedas de USD, CLP, COP, PHP e INR estén programadas para liquidarse (excepto los sábados, domingos y días festivos en Luxemburgo y Francia).

Las solicitudes de suscripción y reembolso podrán realizarse al agente administrativo antes de las 16:00 horas (CET) a más tardar el día anterior al día de valoración correspondiente.

Agente administrativo: BNP Paribas Securities Services, Sucursal de Luxemburgo, 60 avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo.

Los ingresos se reinvierten sistemáticamente.

Perfil de riesgo y de rentabilidad



- La rentabilidad histórica (como la información utilizada para calcular el indicador sintético) no es una indicación fiable del perfil de riesgo futuro del subfondo.
- No se garantiza la categoría de riesgo asociada a este subfondo, que puede cambiar con el tiempo.
- La categoría más baja no significa «libre de riesgo».
- La categoría de riesgo puede explicarse por la inversión activa en distintas clases de activos mientras se sigue tratando de mantener el perfil de riesgo en los límites predefinidos.

Otros riesgos que revisten una importancia significativa para el Fondo y que el indicador no capta de manera adecuada:

- **Riesgo de contraparte:** Este riesgo está relacionado con la capacidad de una contraparte de cumplir sus compromisos (como son el pago, la entrega y el reembolso) en una operación financiera extrabursátil.
- **Riesgo vinculado a la utilización de instrumentos financieros a plazo:** Utilizamos instrumentos financieros a plazo negociados fuera de la bolsa para poder replicar la rentabilidad de la estrategia. Estos instrumentos pueden implicar un conjunto de riesgos que pueden conducir a ajustes o a la propia rescisión del instrumento, lo que puede influir sobre el valor liquidativo.



Gastos

Las comisiones y los gastos sufragados se utilizan para cubrir los costes de funcionamiento del subfondo, incluidos los costes de comercialización y distribución de acciones. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de las inversiones.

Gastos extraordinarios antes o después de la inversión	
Gastos de entrada	Nada
Gastos de salida	Nada
Gastos detraídos del OICVM a lo largo de un año	
Gastos corrientes	0,76% (*)
Gastos detraídos del OICVM en determinadas condiciones específicas	
Comisiones de rentabilidad	Nada

Los gastos de entrada y de salida mostrados son las cifras máximas. En algunos casos usted pagará menos. Puede obtener más información a través de su asesor financiero. (*) La cifra de **gastos corrientes** se basa en los gastos correspondientes pasados determinados el 31 diciembre 2021.

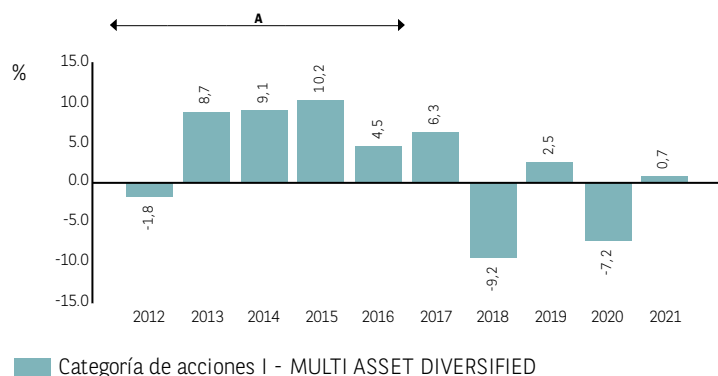
Dicha cifra puede variar de un año a otro. No incluye:

- Comisiones de rentabilidad.
- Los costes de intermediación, exceptuados los gastos de entrada y salida pagados por el subfondo al comprar o vender participaciones de otro organismo de inversión colectiva.

En caso de canje, se puede cobrar a los inversores una comisión máxima del 1.5%.

Si desea más información sobre los gastos, consulte el apartado «Comisiones y gastos» del folleto informativo de la SICAV, que está disponible en la siguiente dirección: <http://www.bnpparibas-am.com>.

Rentabilidad histórica



- La rentabilidad histórica no constituye un indicador de la rentabilidad futura.
- La rentabilidad se calculará neta de gastos de gestión.
- La categoría de acción se lanzó el 19 mayo 2016.
- La rentabilidad histórica se ha calculado en EUR.

A: 02/2008 - 05/2016 : Tras una acción corporativa el 19/05/2016, las rentabilidades enumeradas cubren la rentabilidad histórica simulada y las comisiones del THEAM Quant Multi Asset Diversified [A EUR ACC].

Información útil

- Depositario: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH.
- El presente documento de datos fundamentales para el inversor proporciona información sobre un subfondo de THEAM QUANT- SICAV. El folleto informativo y los informes periódicos son de aplicación a la totalidad de la SICAV que se menciona en la cabecera del documento.
- Los detalles acerca de la política de remuneración actualizada están disponibles en línea en <https://www.bnpparibas-am.com/en/footer/remuneration-policy> o previa solicitud por escrito a la sociedad gestora.
- Los inversores pueden hacer cambios entre los Fondos de THEAM QUANT-. Si desea más información, consulte el folleto informativo o póngase en contacto con su asesor financiero.
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto informativo de la SICAV.
- Los documentos de datos fundamentales para el inversor del subfondo, el folleto informativo y los últimos informes anuales y provisionales se enviarán a los participantes en un plazo de ocho días hábiles tras la recepción de una solicitud por escrito a: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 París Cedex 09.
- El precio de las acciones de la SICAV está disponible en línea en <http://www.bnpparibas-am.com>.
- Para obtener información sobre otras acciones del subfondo, consulte su folleto informativo.
- Dependiendo de su régimen fiscal, las plusvalías y los ingresos asociados a la tenencia de acciones en este subfondo pueden estar sujetos a tributación. Le recomendamos que consulte a su asesor fiscal para obtener más información al respecto.

Este Subfondo está autorizado en el Gran Ducado de Luxemburgo y regulado por la «Commission de Surveillance du Secteur Financier». Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos a 18 febrero 2022.



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The sustainable investor for a changing world