

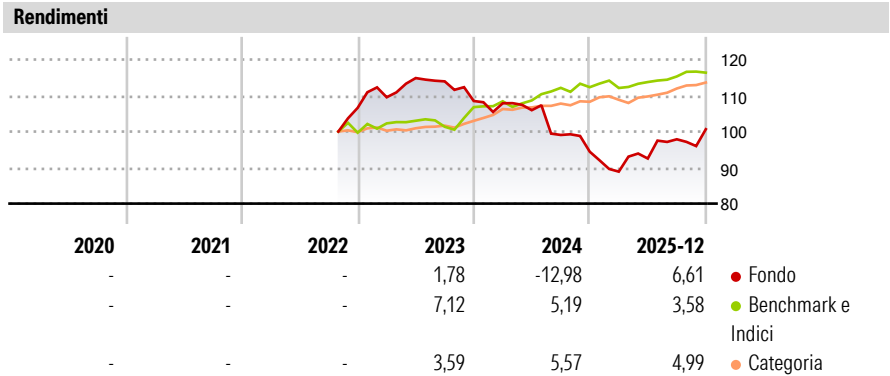
THEAM Quant-Cross Asset High Focus I EUR Capitalisation

| | | | |
|-------------------------------|---|-----------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Alt - Multistrategy | Morningstar Euro Cautious Global Target | Not Benchmarked | ★ |
| | Allocation NR EUR | | |
| | Usato nel Report | | |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The objective of the Sub-fund is to increase the value of its assets over the medium term, through the use of quantitative investment strategies across different asset classes. The Sub-fund targets an annual volatility between 10% and 15%, the achievement of this target is not guaranteed. The Sub-fund will not invest more than 10% of its net assets in units or shares of UCITS or other UCIs.

| Misure di Rischio | | | |
|--|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha | -4,66 | 3Y Sharpe Ratio | -0,50 |
| 3Y Beta | 0,08 | 3Y Std Dev | 8,91 |
| 3Y R-Squared | 0,12 | 3Y Risk | Alto |
| 3Y Info Ratio | -0,74 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 9,73 | 10Y Risk | - |
| Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile) | | | |



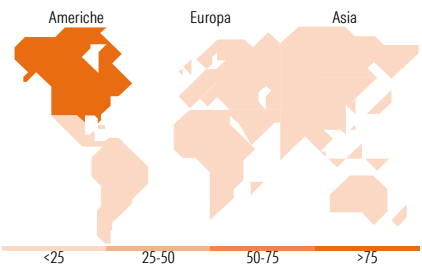
| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 0,06 | 0,41 | 3,14 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 5,11 | 2,55 | 5,98 | 2025 | -5,86 | 4,10 | 5,77 | 2,85 |
| 1-Anno | 8,30 | 3,32 | 6,84 | 2024 | -0,57 | -1,79 | -6,49 | -4,71 |
| 3-Anni Ann.ti | -3,63 | 4,66 | 5,56 | 2023 | 2,76 | 4,86 | -0,80 | -4,78 |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - | 2022 | - | - | - | - |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | | Fondo |
|-------------------------|----------------|-------|
| Duration Effettiva | | - |
| Maturity effettiva | | - |
| Qualità Credito Media | | - |
| Qualità Credito | Alto Med Basso | |
| Sensibilità ai Tassi | Bassa Med Alta | |



| Titoli principali | | |
|---|---------|-------|
| Nome | Settore | % |
| NVIDIA Corp | 📠 | 8,30 |
| Intuit Inc | 📠 | 5,86 |
| Advanced Micro Devices Inc | 📠 | 5,74 |
| Citigroup Inc | 🏦 | 5,45 |
| The Home Depot Inc | 🏠 | 5,17 |
| MercadoLibre Inc | 🛒 | 4,81 |
| Intuitive Surgical Inc | 🏥 | 4,53 |
| Fiserv Inc | 📠 | 4,00 |
| CVS Health Corp | 🏥 | 3,94 |
| Total Return Equity Swap Trs... | — | 3,50 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 51,30 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 49 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 0 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|----------------------------------|-------|
| 🏛️ Governativo | 0,00 |
| ⚙️ Societario | 0,00 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 0,00 |
| 👤 Enti Locali | 0,00 |
| 🏦 Liquidità ed equivalenti | 0,00 |
| 📄 Derivati | 0,00 |
| Coupon Range % | Fondo |
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 0,00 |
| Da 4 a 6 cedole | 0,00 |
| Da 6 a 8 cedole | 0,00 |
| Da 8 a 10 cedole | 0,00 |
| Da 10 a 12 cedole | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | 0,00 |

| Ripartizione Geografica % | Fondo |
|-------------------------------|-------|
| America | 98,72 |
| Stati Uniti | 93,75 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 4,97 |
| Europa | 1,28 |
| Regno Unito | 0,00 |
| Europa Occidentale - Euro | 1,28 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,00 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| Africa | 0,00 |
| Medio Oriente | 0,00 |
| Asia | 0,00 |
| Giappone | 0,00 |
| Australasia | 0,00 |
| Asia - Paesi Sviluppati | 0,00 |
| Asia - Emergente | 0,00 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|-------------------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------------|
| Società di Gestione | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe | Patrimonio Classe (Mln) | 1,25 EUR | Investimento Min. Ingresso | 100.000 EUR |
| Telefono | +33 (0)145 252 525 | (29/01/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bnpparibas-am.fr | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | 0,75% |
| Data di Partenza | 13/10/2022 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,76% |
| Nome del Gestore | Maxime Panel | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 05/11/2021 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (29/01/2026) | EUR 99,15 | ISIN | LU2346213866 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 357,50 EUR | | | | |