

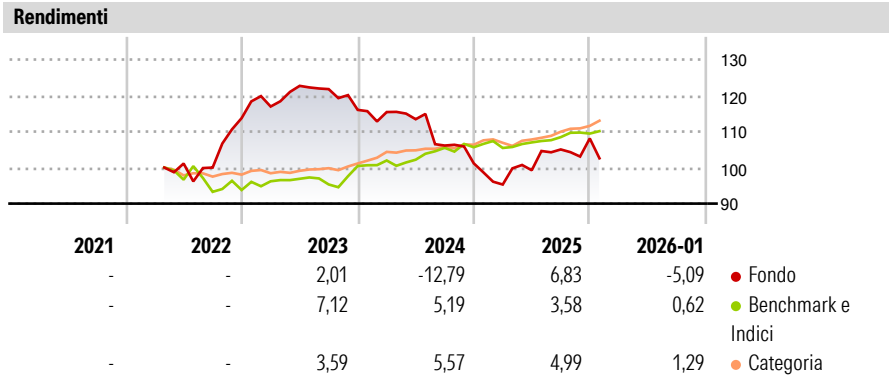
THEAM Quant-Cross Asset High Focus J EUR Capitalisation

| | | | |
|-------------------------------|---|-----------------------------|----------------------------|
| 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 | -7,06 | 3Y Sharpe Ratio | -0,81 |
| 3Y Beta | -0,16 | 3Y Std Dev | 9,00 |
| 3Y R-Squared | 0,47 | 3Y Risk | Alto |
| 3Y Info Ratio | -0,92 | 5Y Risk | - |
| 3Y Tracking Error | 10,08 | 10Y Risk | - |
| Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile) | | | |



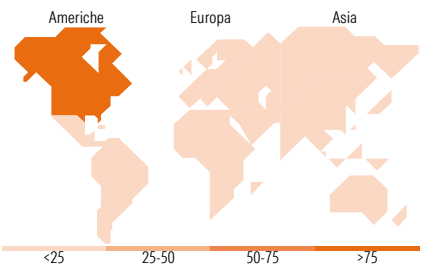
| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 2,36 | 0,93 | 2,96 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 3,11 | 2,93 | 5,52 | 2025 | -5,82 | 4,15 | 5,83 | 2,91 |
| 1-Anno | 9,26 | 3,54 | 6,03 | 2024 | -0,52 | -1,73 | -6,44 | -4,65 |
| 3-Anni Ann.ti | -3,87 | 4,91 | 5,47 | 2023 | 2,82 | 4,91 | -0,74 | -4,73 |
| 5-Anni Ann.ti | - | - | - | 2022 | - | - | -1,11 | 13,74 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 09/02/2026

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 | IT | 8,30 |
| Intuit Inc | Software | 5,86 |
| Advanced Micro Devices Inc | IT | 5,74 |
| Citigroup Inc | Banche | 5,45 |
| The Home Depot Inc | Retail | 5,17 |
| MercadoLibre Inc | E-commerce | 4,81 |
| Intuitive Surgical Inc | Medicina | 4,53 |
| Fiserv Inc | Software | 4,00 |
| CVS Health Corp | Farmaceutici | 3,94 |
| Total Return Equity Swap Trs... | Derivati | 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) | 15,17 EUR | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | +33 (0)145 252 525 | (09/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | www.bnpparibas-am.fr | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 25/04/2022 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 0,54% |
| Nome del Gestore | Maxime Panel | UCITS | Si | Commissione di incentivo | - |
| Data Inizio Gestione | 05/11/2021 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (09/02/2026) | EUR 103,43 | ISIN | LU2346215481 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 357,50 EUR | | | | |

(31/12/2025)