Informations clés pour l'investisseur

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de ce compartiment. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce compartiment et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

EQUITY EUROPE INCOME DEFENSIVE, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe "I EUR Distribution" - ISIN code LU1049887091

Ce sous-fonds est géré par BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, qui fait partie du Groupe BNP Paribas.

Objectifs et politique d'investissement

L'objectif du Compartiment consiste à générer un revenu et une appréciation du capital (i) en étant exposé à un panier d'actions européennes à haut dividende et (ii) en mettant en œuvre une stratégie sur options systématique qui vise à générer un revenu supplémentaire et à réduire le risque en minimisant la volatilité dans le Compartiment.

En vue de réaliser son objectif d'investissement, le Compartiment met en œuvre une stratégie d'investissement quantitative (la Stratégie) combinant deux piliers de la performance :

(a) une exposition longue à un panier d'actions européennes à haut dividende par le biais de l'indice BNP Paribas High Dividend Europe Equity Net Total Return (l'Indice de Stratégie). L'Indice de Stratégie vise à sélectionner les actions suivant un processus reposant sur l'analyse de leur capacité à verser des dividendes élevés de manière durable et récurrente ; et

(b) une stratégie sur options systématique complémentaire sur l'indice Euro Stoxx 50 visant à améliorer le ratio risque/rendement comparativement à un investissement direct dans l'Indice de Stratégie en adoptant des positions courtes sur les options d'achat sur l'indice Euro Stoxx 50 avec pour objectif de générer un revenu supplémentaire tout en limitant la volatilité du Compartiment et des positions longues sur les options de vente sur l'indice Euro Stoxx 50 afin de réduire la volatilité du Compartiment.

L'Indice de Stratégie est un indice diversifié représentant un investissement dynamique dans un panier d'actions européennes. L'Indice de Stratégie repose sur un algorithme quantitatif développé par BNP Paribas et est rebalancé chaque mois par le biais d'un algorithme spécifique. Le rebalancement de l'Indice de Stratégie se fait sur une base mensuelle et n'implique aucun coût pour ce dernier.

La composition complète de l'Indice de Stratégie est disponible sur le site Internet : https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com. La méthode de calcul de l'indice est disponible directement sur : https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com/nr/HEUNTR.pdf.

La Stratégie du Compartiment est considérée comme active. Le Compartiment n'a pas d'indice de référence, aucune comparaison des performances n'est donc possible.

La Stratégie sera mise en œuvre par la souscription d'instruments dérivés de gré à gré, conformément à une Politique de réplication synthétique. Dans le cadre d'une telle Politique de réplication synthétique, le Compartiment ne détient en fait aucun des titres sous-jacents de l'indice, mais repose plutôt sur des instruments dérivés de gré à gré pour répliquer la performance de l'Indice de Stratégie. Le Compartiment investit à tout moment au moins 75 % de ses actifs nets dans des actions émises par des sociétés ayant leur siège social dans un État membre de l'Espace économique européen.

Les investisseurs peuvent effectuer des souscriptions ou des rachats au cours de tout jour d'ouverture complet des Bourses en France, au Royaume-Uni, en Allemagne, en Suède, en Italie, en Suisse, en Norvège et au Danemark (à l'exception des samedis et dimanches, ainsi que des jours fériés au Luxembourg et en France).

Les demandes de souscription et de rachat peuvent être déposées auprès de l'agent administratif avant 12 h 00 CET au plus tard le jour d'évaluation concerné.

Agent administratif : BNP Paribas Securities Services, succursale de Luxembourg, 60, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.

Un dividende peut être distribué.

Profil de risque et de rendement

Risque plus faible — Risque plus élevé



Rendement potentiellement plus faible — Rendement potentiellement plus élevé

1	2	3	4	**5**	6	7

- Les données historiques telles que celles utilisées pour calculer l'indicateur synthétique pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur du compartiment.
- La catégorie de risque associée à ce compartiment n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps.
- La catégorie la plus faible ne signifie pas «sans risque».

La catégorie de risque se justifie par l'investissement selon une stratégie action visant à réduire le risque et la volatilité liés aux actions.

Risque(s) important(s) non pris en compte dans l'indicateur dont la réalisation peut entrainer une baisse de la valeur liquidative :

- Risque de contrepartie: lié à la capacité de la contrepartie sur les marchés de gré à gré à respecter ses engagements tels que le paiement, la livraison ou le remboursement.
- Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers à terme : Nous utilisons des instruments financiers à terme négociés de gré à gré pour permettre de répliquer la performance de la stratégie. Ces instruments peuvent impliquer une série de risques qui pourraient conduire à des ajustements ou même à une résiliation de l'instrument, qui pourrait influer sur la valeur liquidative.

Frais

Les frais et commissions acquittés servent à couvrir les coûts d'exploitation du compartiment y compris les coûts de commercialisation et de distribution des actions, ces frais réduisent la croissance potentielle des investissements.

Frais ponctuels prélevés avant ou après investissement	
Frais d'entrée	Néant
Frais de sortie	Néant
Frais prélevés par l'OPCVM sur une année	
Frais courants	0,80%(*)
Frais prélevés par l'OPCVM dans certaines circonstances	
Commission de performance	Néant

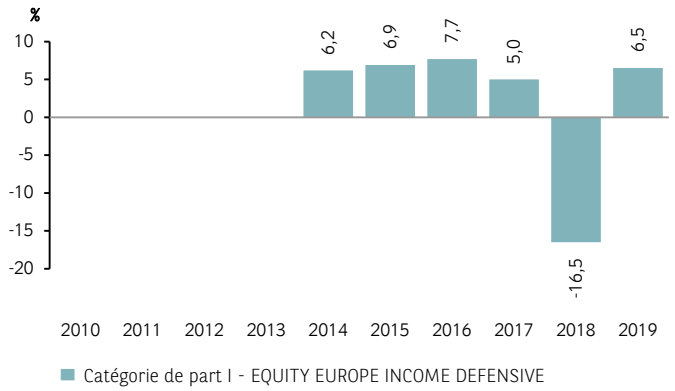
Les frais d'entrée et de sortie sont des maxima. Dans certains cas, ces frais sont moindres. L'investisseur peut obtenir de son conseil ou de son distributeur le montant effectif des frais d'entrée et de sortie.
(*) L'évaluation des frais courants se fonde sur les frais courants de l'exercice précédent clos en décembre 2019. Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Les frais courants ne comprennent pas :

- les frais d'intermédiation, excepté dans le cas de frais d'entrée et/ou de sortie payés par le compartiment lorsqu'il achète ou vend des parts d'un autre véhicule de gestion collective.

En cas de conversion, une commission maximale de 1,5% pourra être facturée aux investisseurs.

Pour plus d'information sur les frais, veuillez vous référer à la rubrique "Frais et commissions" du prospectus du compartiment, consultable via le site Internet www.bnpparibas-am.com.

Performances passées



- Les performances passées ne sont pas un indicateur des performances futures ;
- Les performances sont calculées nettes de frais de gestion ;
- La catégorie d'action a été lancée le 6 novembre 2014 ;
- Les performances passées ont été évaluées en EUR.
- 06/2013 - 11/2014 : À la suite d'une opération sur titres le 06/11/2014, les performances indiquées intègrent la simulation des performances passées et des frais du THEAM Quant Equity Europe Income [A - EUR D, H].

Informations pratiques

- Dépositaire : BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH
- Ce document d'informations clés pour l'investisseur (DICI) décrit un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-, le prospectus et les rapports périodiques sont établis pour l'ensemble de la SICAV identifiée en tête du document.
- Les détails de la politique de rémunération actualisée sont disponibles sur le site internet http://www.bnpparibas-am.com/fr/politique-de-remuneration ou sur simple demande écrite auprès de la société de gestion.
- Les investisseurs peuvent échanger des actions d'un compartiment contre des actions d'un autre compartiment de THEAM QUANT-. Veuillez consulter le prospectus ou contacter votre conseiller financier pour plus de détails.
- La responsabilité de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France ne peut être engagée que sur la base de déclarations contenues dans le présent document qui seraient trompeuses, inexactes ou non cohérentes avec les parties correspondantes du prospectus de la SICAV.
- Le Compartiment est éligible au Plan d'Epargne en Actions (PEA).
- Les DICI, prospectus et derniers documents annuels et périodiques du compartiment sont adressés sur simple demande écrite des porteurs de parts auprès de: BNP PARIBAS Asset Management France - MAQS CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09.
- Le cours de l'action de la SICAV est disponible sur le site Internet www.bnpparibas-am.com.
- Pour obtenir des informations relatives aux autres actions du compartiment, vous pouvez vous référer au prospectus du compartiment.
- Selon votre régime fiscal, les plus-values et revenus éventuels liés à la détention d'actions de ce compartiment peuvent être soumis à imposition. Nous vous conseillons de vous renseigner à ce sujet auprès d'un conseiller fiscal.

Le compartiment a été agréé au Luxembourg et est réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier.
Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 2 octobre 2020.