

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 Eurozone Factor Defensive, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe « C EUR Capitalisation » -code ISIN LU1893651874

Ce Compartiment 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 une appréciation du capital (i)étant exposé à un panier d'actions de l'Union économique et monétaire de l'Union européenne (la zone euro) et (ii)mettant en œuvre une stratégie sur options systématique qui vise 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 de la performance

(a)exposition longue à un panier d'actions européennes par le biais de l'indice BNPDEFI Equity Eurozone Long Net TR (l'Indice de Stratégie). L'Indice de Stratégie vise à sélectionner les actions suivant un processus d'investissement systématique et quantitatif

(b)stratégie sur options systématique complémentaire sur l'indice EURO STOXX~ visant à améliorer le ratio risque/rendement comparativement à un investissement direct dans l'Indice de Stratégie en adoptant des positions longues sur les options de vente sur l'indice EURO STOXX~ financées, dans la mesure du possible, par des positions courtes sur des options d'achat sur l'indice EURO STOXXLa stratégie sur options de vente, particulièrement adaptée à des marchés très baissiers, permet au Compartiment de limiter les effets d'une chute des marchés d'actions européens et, ainsi, de limiter sa volatilité. La stratégie sur options d'achat est particulièrement adaptée à des marchés stables ou sans franche orientation.

L'Indice de Stratégie repose sur un processus d'investissement systématique développé par BNPet est rebalancé chaque mois par le biais d'un algorithme spécifique visant (i)~ à sélectionner des actions au moyen d'une combinaison de quatre de performancevaleur, qualité, dynamique et faible volatilité(ii)~ à tirer parti de cette diversification factorielle de l'investissement et (iii)~ à maintenir un bêta proche de~ et une erreur de suivi exinférieure à 3,5c.-à-d. à atteindre une performance corrélée, par rapport à la performance de l'indice EURO STOXX (NR) (code BloombergSXXT Index).

La composition complète de l'Indice de Stratégie est disponible sur le site Internet<https://indx.bnpparibas.com>. La méthode de calcul de l'indice est disponible directement sur<https://indx.bnpparibas.com/nr/BNPIDFZT.pdf>.

Il est possible que, pour obtenir une performance corrélée par rapport à la performance de l'indice EURO STOXX (NR), l'Indice de Stratégie doive avoir recours à un effet de levier par le biais d'une exposition longue ou courte supplémentaire à des contrats à terme standardisés. Il faut noter que la réplique et le rebalancement de l'Indice de Stratégie entraînent des frais qui sont indiqués dans le règlement de l'Indice de Stratégie.

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

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

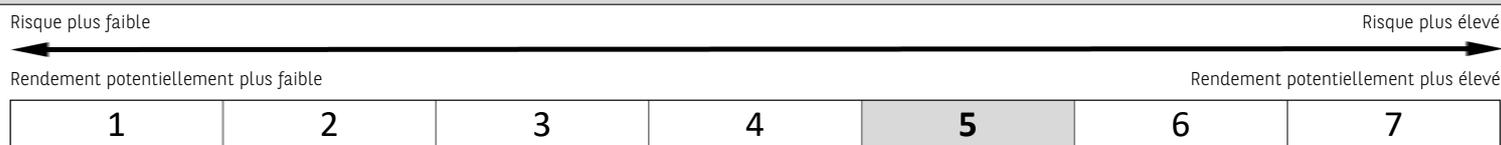
Les investisseurs peuvent effectuer des souscriptions ou des rachats au cours de tout jour d'ouverture complet des Bourses de Paris, de Francfort, d'Amsterdam, de Madrid et de Milan (à l'exception des samedis et dimanches, ainsi que des jours fériés au Luxembourg et en France).

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

Agent administratifBNP Securities Services, succursale de Luxembourg, 60, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg.

Les revenus sont réinvestis de manière systématique.

Profil de risque et de rendement



- 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 dans une stratégie actions qui vise à réduire le risque et la volatilité liés aux actions.

D'autres risques importants pour le Fonds, mais qui ne sont pas adéquatement pris en considération par l'indicateur, sont décrits ci-dessous :

- **Risque de contrepartie** : ce risque est associé à la capacité d'une contrepartie à une transaction financière de gré à gré d'honorer ses engagements comme le paiement, la livraison et le remboursement.

- **Risque lié à l'utilisation d'instruments financiers à terme** : nous utilisons des instruments financiers à terme négociés de gré à gré afin de suivre la performance de la stratégie. Ces instruments peuvent impliquer une série de risques qui pourraient conduire à des ajustements, voire à une résiliation de l'instrument, ce qui peut influencer sur la valeur nette d'inventaire.



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 | 3,00% |
| Frais de sortie | Néant |

Il s'agit du pourcentage maximum pouvant être prélevé sur votre capital avant qu'il soit investi.

Frais prélevés par l'OPCVM chaque année

| | |
|----------------|-----------|
| Frais courants | 1,55% (*) |
|----------------|-----------|

Frais prélevés par l'OPCVM dans certaines circonstances spécifiques

| | |
|---------------------------|-------|
| Commission de performance | Néant |
|---------------------------|-------|

Les frais d'entrée et de sortie indiqués correspondent aux montants maximums pouvant être prélevés. Vous pouvez payer moins dans certains cas. Renseignez-vous auprès de votre conseiller financier.

(*) Le pourcentage des **frais courants** se fonde sur les dépenses passées déterminées au 31 décembre 2021.

Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Il ne comprend pas :

- Les commissions de surperformance.
- Les frais intermédiaires, à l'exception des frais d'entrée ou de sortie payés par le compartiment à l'achat ou à la vente de parts d'un autre organisme de placement collectif.

En cas de conversion, les investisseurs peuvent être tenus de verser une commission d'un maximum de 1.5%.

Pour en savoir plus sur les frais, veuillez vous reporter à la section « Frais et commissions » du prospectus de la SICAV, disponible à l'adresse suivante : <http://www.bnpparibas-am.com>.

Performances passées



■ Catégorie d'action C - Equity Eurozone Factor Defensive

- 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 03 décembre 2018.
- Les performances passées ont été calculées en devise EUR.

Informations pratiques

- Dépositaire : BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH.
- Le document d'information clé pour l'investisseur (DICI) décrit le compartiment de la SICAV THEAM QUANT- ; le prospectus et les rapports périodiques s'appliquent à la totalité de la SICAV identifiée en en-tête.
- Les détails de la politique de rémunération actualisée sont disponibles en ligne sur <https://www.bnpparibas-am.com/fr/politique-de-remuneration> ou, sur demande écrite auprès de la société de gestion.
- Les investisseurs peuvent effectuer des conversions entre des Fonds de THEAM QUANT-. Veuillez consulter le prospectus ou contacter votre conseiller financier pour de plus amples informations.
- 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 incohérentes avec les parties correspondantes du prospectus de la SICAV.
- Les DICI du compartiment, le prospectus et les rapports annuels et semestriels les plus récents seront envoyés aux porteurs de parts dans un délai de huit jours ouvrables à compter de la réception de la demande écrite envoyée à : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09.
- Le prix des actions de la SICAV est disponible en ligne sur <http://www.bnpparibas-am.com>.
- Pour plus d'informations sur les autres actions du compartiment, veuillez consulter le prospectus du compartiment.
- Selon votre régime fiscal, les plus-values et les revenus provenant de la détention d'actions du compartiment peuvent être imposables. Nous vous recommandons de consulter votre conseiller fiscal pour plus d'informations.

Ce Compartiment est agréé au Grand-Duché de Luxembourg et réglementé par la Commission de Surveillance du Secteur Financier. Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes au 18 février 2022.

