Datos fundamentales para el inversor

El presente documento contiene datos fundamentales para el inversor de este subfondo. No se trata de un documento promocional. Los datos que contiene se le ofrecen de acuerdo con una obligación legal, para ayudarle a comprender en qué consiste una inversión en este subfondo y los riesgos que comporta. Le aconsejamos que lo lea para decidir con conocimiento de causa si desea invertir o no.

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

Clase «C EUR Distribution» - Código ISIN LU1049885988

Este subfondo está gestionado por BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, que forma parte del Grupo BNP Paribas.

Objetivos y política de inversión

El objetivo de este Subfondo es proporcionar ingresos y crecimiento del capital (i) exponiéndose a una cesta de valores de renta variable europeos de dividendos altos y (ii) aplicando una estrategia de opciones sistemáticas cuyo objetivo es generar ingresos adicionales y reducir el riesgo minimizando la volatilidad del Subfondo.

Para lograr su objetivo de inversión, el Subfondo implementa una estrategia de inversión cuantitativa (la Estrategia) que combina dos pilares de rendimiento:

(a) una exposición larga a una cesta de valores de renta variable europeos de dividendos altos a través del BNP Paribas High Dividend Europe Equity Net Total Return Index (el Índice de la Estrategia). El Índice de la Estrategia tiene como objetivo seleccionar valores de renta variable siguiendo un proceso basado en el análisis de su capacidad de pagar dividendos altos, recurrentes y sostenibles; y

(b) una estrategia complementaria de opciones sistemáticas del Euro Stoxx 50 Index diseñada para mejorar la relación riesgo/rentabilidad en comparación con una inversión directa en el Índice de la Estrategia adoptando posiciones cortas en opciones de compra del Euro Stoxx 50 Index, cuyo objetivo es generar ingresos adicionales mientras limita la volatilidad del Subfondo, y posiciones largas en opciones de venta del Euro Stoxx 50 Index para reducir la volatilidad del Subfondo.

El Índice de la Estrategia es un índice diversificado que representa una inversión dinámica en una cesta de valores de renta variable europeos. El Índice de la Estrategia se basa en un algoritmo cuantitativo desarrollado por BNP Paribas y se reequilibra todos los meses utilizando un algoritmo específico. El reequilibrio del Índice de la Estrategia se realiza todos los meses y no implica ningún coste para este.

El desglose total del Índice de la Estrategia se encuentra disponible en la página web: https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com. El método de cálculo del índice está disponible directamente en: https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com/nr/HEUNTR.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 implementará 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 del Índice de la Estrategia. El Subfondo invierte en todo momento al menos el 75 % de su patrimonio neto en renta variable emitida por empresas que tengan su domicilio social en un Estado miembro del Espacio Económico Europeo.

Los inversores podrán efectuar suscripciones o reembolsos los días en que las Bolsas de Francia, Reino Unido, Alemania, Suecia, Italia, Suiza, Noruega y Dinamarca estén abiertas (salvo sábados y domingos y los días festivos en Luxemburgo y Francia).

Las solicitudes de suscripción y reembolso pueden dirigirse al agente administrativo antes de las 12:00 horas (CET), a más tardar en la fecha de valoración pertinente.

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

Se pueden distribuir dividendos.

Perfil de riesgo y remuneración

Menor riesgo — Mayor riesgo

Remuneración normalmente menor — Remuneración normalmente mayor

1	2	3	4	**5**	6	7

- La rentabilidad histórica como la utilizada para calcular el indicador sintético podría no constituir una indicación fiable del perfil de riesgo futuro del subfondo.
- La categoría de riesgo asociada a este subfondo no está garantizada y podrá evolucionar a lo largo del tiempo.
- La categoría más débil no implica que esté «sin riesgo».

La categoría de riesgo puede explicarse por la inversión en una estrategia de renta variable que tiene como objetivo reducir el riesgo y la volatilidad provocada por las acciones.

Riesgo(s) importante(s) no contemplado(s) en el indicador cuya realización puede comportar una reducción del valor liquidativo:

- Riesgo de contraparte: vinculado a la capacidad de la contraparte en mercados extrabursátiles a respetar sus compromisos, tales como el pago, la liberación o el reembolso.
- 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 abonados sirven para cubrir los costes de explotación del subfondo, incluidos los costes de comercialización y de distribución de las acciones, que reducen el crecimiento potencial de las inversiones.

Gastos no recurrentes percibidos con anterioridad o con posterioridad a la inversión	
Gastos de entrada	3,00%
Gastos de salida	Nada
El porcentaje indicado es el máximo que se podrá detraer de su capital antes de que sea invertido.	
Gastos cobrados por el OICVM en un año	
Gastos corrientes	1,55%(*)
Gastos cobrados por el OICVM bajo determinadas circunstancias	
Comisión de rentabilidad	Nada

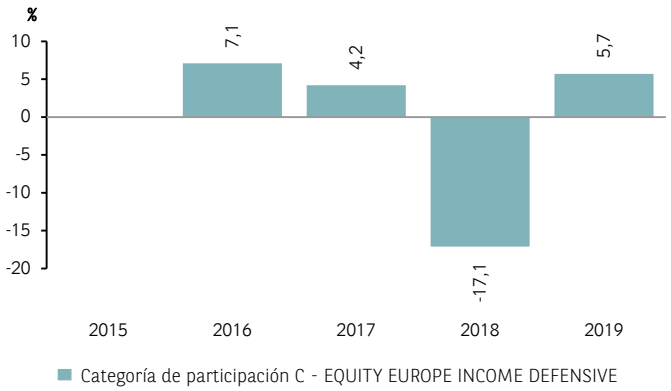
Los gastos de entrada y de salida son máximos. En según qué casos, estos gastos pueden ser inferiores. El inversor puede obtener de su asesor o de su distribuidor el importe en efectivo de los gastos de entrada y de salida.
(*) La evaluación de los gastos corrientes se basa en los gastos corrientes del ejercicio anterior cerrado el diciembre 2019. Esta cifra puede variar de un ejercicio a otro.Los gastos corrientes no incluyen:

- los gastos de intermediación, excepto en el caso de gastos de entrada y/o de salida, abonados por el subfondo al comprar o vender participaciones de otro vehículo de gestión colectiva.

En el caso de canje, se puede cobrar a los inversores una comisión máxima del 1,5%.

Para obtener más información sobre los gastos, consulte la sección «Comisiones y gastos» del folleto del subfondo, disponible en esta dirección: www.bnpparibas-am.com.

Rentabilidad histórica



- La rentabilidad histórica no es un indicador de la rentabilidad futura
- La rentabilidad se calcula neta de gastos de gestión
- La categoría de acción se lanzó el 19 febrero 2015 ;
- La rentabilidad histórica ha sido evaluada en EUR.

Información práctica

- Depositario: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH
- Este documento de datos fundamentales para el inversor (DDFI) describe un subfondo de la SICAV THEAM QUANT-, el folleto y los informes periódicos se establecen para el conjunto de la SICAV que aparece en la cabecera del documento.
- Puede obtener más información sobre la política de remuneración actualizada en la dirección http://www.bnpparibas-am.com/en/remuneration-disclosure o previa solicitud escrita a la sociedad gestora del subfondo.
- Los inversores pueden hacer cambios entre los Fondos de THEAM QUANT-. Si desea más información, consulte el folleto o póngase en contacto con su asesor financiero.
- No se podrá exigir responsabilidad alguna a BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France excepto en el caso de que las declaraciones contenidas en el presente documento resulten engañosas, inexactas o incoherentes en relación con las partes correspondientes del folleto de la SICAV.
- El DDFI, el folleto y los últimos documentos anuales y periódicos redactados en francés se envían de forma gratuita hábiles previa solicitud escrita a: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - MAQS CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09.
- El precio de las acciones de la SICAV está disponible en la dirección: **www.bnpparibas-am.com.**
- Para obtener más información sobre las otras acciones del subfondo puede consultar el folleto del compartimento.
- Según su régimen fiscal, las plusvalías y los posibles ingresos relacionados con la posesión de acciones de este subfondo pueden estar sujetos a impuestos. Le aconsejamos que consulte con un asesor fiscal.

El subfondo se estableció en Luxemburgo y está regulado por la Commission de Surveillance du Secteur Financier. Los datos fundamentales para el inversor facilitados son exactos y están actualizados a 2 octubre 2020.