

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.

World Climate Carbon Offset Plan, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe "I USD Capitalisation" - ISIN code LU2051099864

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 (i) accroître la valeur de ses actifs à moyen terme en étant exposé à un panier dynamique d'actions cotées sur les marchés internationaux, dont les composantes sont choisies à l'aide d'une méthode de sélection systématique basée sur des critères environnementaux, sociaux ou de gouvernance (ESG), ainsi que des critères d'émission de carbone, de transition énergétique et de solidité financière des sociétés et (ii) compenser son empreinte carbone (Cadres 1 et 2).

En vue de réaliser son objectif d'investissement, le Compartiment met en œuvre une stratégie d'investissement quantitative (la Stratégie) par le biais de l'indice BNP Paribas Equity World Climate Care NTR (l'Indice de Stratégie).

L'univers d'investissement est composé d'actions sélectionnées sur la base de leur score ESG, de leurs contraintes de liquidité, de leur note de transition énergétique et de leur solidité financière, qui ne sont aucunement impliquées dans des activités litigieuses ou des controverses majeures et qui affichent une faible implication dans les activités ayant trait à l'exploitation du charbon, du pétrole et du gaz et qui (i) cessent ou (ii) abandonnent progressivement les pratiques largement considérées comme non durables. L'application de critères ESG, tels que, mais sans s'y limiter, l'efficacité énergétique, le respect des droits de l'homme et des travailleurs ou l'indépendance du conseil d'administration, suit une approche Best-in-Class et de sélectivité qui vise à sélectionner les entreprises leaders de leur secteur en excluant au moins 25 % des titres de l'univers d'investissement initial.

L'algorithme d'allocation suit alors une approche d'investissement thématique d'une manière qui cherche à maximiser les critères de transition énergétique du panier d'actions qui en résulte, en fonction des principales contraintes liées à la notation ESG, à l'atténuation des risques, à l'empreinte carbone ou à la diversification sectorielle, tout en contrôlant l'écart du portefeuille par rapport à l'indice STOXX Global 1800 Net Return Index USD, l'objectif étant que l'erreur de suivi contrôlée ne dépasse pas 5 %.

Une stratégie extra-financière peut comporter des limites méthodologiques telles que le risque lié aux investissements ESG ou le risque lié à une allocation systématique intégrant des critères extra-financiers.

L'Indice de Stratégie repose sur un modèle systématique conçu par BNP Paribas et est rebalancé chaque trimestre par le biais d'un algorithme d'optimisation. Le rebalancement de l'Indice de Stratégie n'implique aucun coût pour celui-ci. 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/BNPIEWCC.pdf>.

Une Compensation de l'empreinte carbone est appliquée par la Société de gestion par l'utilisation d'un type de crédits carbone, la VER (Verified Emission Reduction, réduction d'émissions vérifiée) comme suit : La Société de gestion calcule l'empreinte carbone (Cadre 1 et Cadre 2) en utilisant la composition des Actifs sous-jacents du Compartiment afin d'établir le montant de VER requis pour compenser les émissions de carbone. Tous les montants de VER requis pour lesquels une compensation aura été réalisée seront annulés afin de matérialiser la compensation effective.

La liste des projets sous-jacents VER sélectionnés par la Société de gestion ainsi que leur description est disponible sur : <https://docfinder.bnpparibas-am.com/api/files/4E0A58B3-05C7-4008-86CE-FDB947DD5919>.

La Compensation de l'empreinte carbone peut être considérée comme partielle dans la mesure où (i) la Société de gestion ne prend pas en compte le Cadre 3 lors du calcul des émissions de carbone, et (ii) elle ne concerne que les émissions de carbone liées à la composition de l'Indice de Stratégie défini ci-dessous et non celles liées aux instruments financiers détenus dans les actifs du Fonds à l'égard desquels une Politique de réplique synthétique est appliquée.

La Stratégie du Compartiment est considérée comme active. L'indice de référence du Compartiment est l'indice STOXX Global 1800 Net Return Index USD, sans objectif de réplique de ce dernier.

La Stratégie est mise en œuvre soit par la souscription d'instruments dérivés de gré à gré, conformément à une Politique de réplique synthétique, soit en espèces, en investissant directement dans un panier d'actions qui composent l'Indice de Stratégie. Dans le cadre d'une telle Politique de réplique synthétique, le Compartiment ne détient en réalité 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. Dans le cadre de la Politique de réplique synthétique, le Compartiment investit à tout moment au moins 75 % de ses actifs nets dans des actions et/ou des titres considérés comme équivalents à des actions émis par des sociétés de tout pays.

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 Finlande, en Allemagne, en Belgique, aux Pays-Bas, aux États-Unis, au Canada, au Japon et en Australie (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 16 h 00 CET au plus tard le Jour ouvrable précédant 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.

Les revenus sont réinvestis de manière systématique.

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 effectué principalement dans des Actions, dont la valeur peut fluctuer considérablement. Ces fluctuations sont souvent amplifiées à court terme.

Risque(s) important(s) non pris en compte dans l'indicateur dont la réalisation peut entraîner 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 influencer 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	0,82% ^(*)
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.

La Société de gestion utilise une partie des frais de gestion pour compenser l'empreinte carbone du Compartiment.

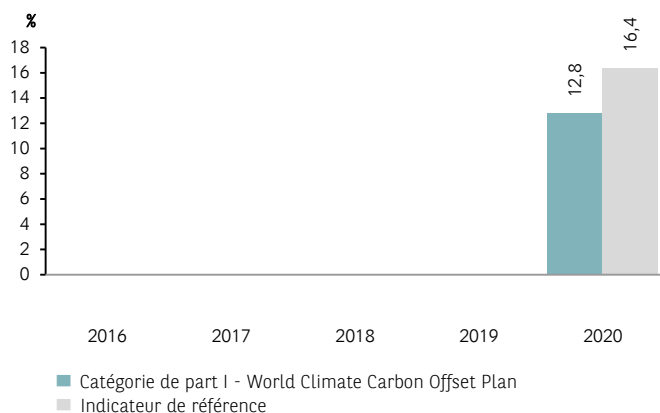
(*) L'évaluation des frais courants se fonde sur les frais courants de l'exercice précédent clos en décembre 2020. Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Les frais courants ne comprennent pas :

- 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 5 novembre 2019 ;
- Les performances passées ont été évaluées en USD.

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.
- 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.
- Informations pour les investisseurs en Suisse : le prospectus, les informations clés pour l'investisseur, les statuts, ainsi que les rapports annuel et semestriel peuvent être obtenus gratuitement auprès du représentant en Suisse, BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zurich. Le service de paiement en Suisse est BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zurich.

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 1 juillet 2021.