

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 US PREMIUM INCOME, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe "I USD Capitalisation" - ISIN code LU1480597480

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 par la mise en œuvre d'une stratégie sur options systématique sur certaines actions américaines, visant à produire des revenus sur les marchés haussiers ou modérément baissiers. Le Compartiment vise un revenu de 5 % par an, mais rien ne garantit que cet objectif sera atteint.

En vue de réaliser son objectif d'investissement, le Compartiment met en œuvre une stratégie d'investissement quantitative (la Stratégie) qui consiste à vendre des options de vente à court terme sur certaines actions américaines par le biais de l'indice BNP Paribas Stock Put Write US (l'Indice de Stratégie).

Le modèle utilisé pour construire l'Indice de Stratégie vise à :

- sélectionner des actions chaque mois (Rebalancement), à l'issue d'un processus qui repose sur des critères du marché et les fondamentaux. L'objectif consiste à examiner l'univers d'investissement afin d'identifier les actions qui bénéficient d'un modèle d'entreprise durable, d'une hausse des cours favorable, d'une capitalisation boursière moyenne élevée, d'une faible corrélation aux actions américaines, d'une évaluation intéressante de la prime d'option et de conditions de négociation favorables sur le marché des options. L'univers d'investissement de l'Indice de Stratégie est composé des plus grandes capitalisations boursières américaines qui offrent des conditions de liquidité satisfaisantes.
- vendre activement, à parts égales, des options de vente hors du cours à court terme sur chacune des actions sélectionnées dans le cadre du processus susmentionné (« Stratégie de vente d'options de vente »). Les Stratégies de vente d'options de vente visent à générer des revenus tout en limitant la volatilité générale et sont particulièrement adaptées aux marchés haussiers ou modérément baissiers.

L'Indice de Stratégie est un indice diversifié qui repose sur un algorithme quantitatif développé par BNP Paribas. 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/SPUSTR.pdf>.

Les investisseurs sont informés qu'il existe des frais de répliation annuels liés à la vente active d'options de vente à court terme, ainsi que des frais supplémentaires découlant de la gestion du portefeuille de Stratégies de vente d'options de vente au titre de chaque jour de Rebalancement. Ces frais réduisent les performances de l'Indice de Stratégie, et indirectement celles du Compartiment.

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.

Pour mettre en œuvre la Stratégie, le Compartiment utilise une Politique de répliation synthétique par la souscription d'Instruments dérivés de gré à gré. Dans le cadre d'une telle Politique de répliation synthétique, le Compartiment investit ses actifs dans des Valeurs mobilières ou des Instruments du marché monétaire (les Actifs de financement) et échange jusqu'à 100 % de la performance des Actifs de financement via des Instruments dérivés de gré à gré afin d'obtenir une exposition à la Stratégie. Dans le cadre de la Politique de répliation 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 de la Bourse de New York (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.

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 la performance de l'Indice de Stratégie, qui peut fortement fluctuer à la hausse ou à la baisse et qui implique un risque de fluctuation rapide et forte de la valeur des investissements.

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.
- **Risque de liquidité**: Ce risque résulte de la difficulté de vendre un titre à sa juste valeur et dans un délai raisonnable du fait d'un manque d'acheteurs.

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	0,76% ^(*)
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.

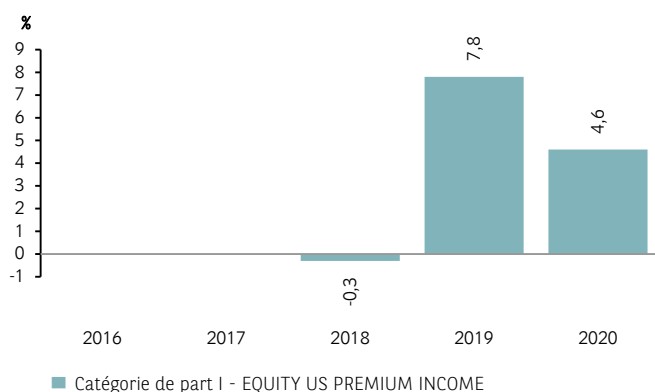
(*) L'évaluation des frais courants se fonde sur les frais courants de l'exercice précédent clos en décembre 2020. Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Les frais courants ne comprennent pas :

- 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 18 juillet 2017 ;
- 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.

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 19 février 2021.