

# 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.

## FIXED INCOME DIVERSIFIER, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe « C EUR Capitalisation » -code ISIN LU2051084080

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 est d'accroître la valeur de ses actifs à moyen terme, en étant exposé à un portefeuille dynamique mondial de positions longues et courtes de taux du marché monétaire à court terme et d'obligations d'État à long terme. Le portefeuille est construit à l'aide d'une sélection systématique de sources de rendement diversifiées sur les marchés de taux d'intérêt, tout en visant (i) à maintenir la volatilité annuelle du compartiment à un niveau cible de 4,5et (ii) à atteindre la neutralité du marché des obligations d'État à moyen terme.

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

(a) un portefeuille de positions longues et courtes d'instruments du marché monétaire (le Portefeuille à court terme) qui tente d'identifier et de monétiser les tendances des taux d'intérêt à court terme en prenant une exposition longue ou courte sur les contrats à terme sur taux d'intérêt à court terme en EUR et en USD.

(b) un portefeuille de positions longues et courtes d'obligations d'État à long terme (le Portefeuille d'obligations) qui vise à identifier et à mettre en évidence des sources diversifiées de rendement provenant d'opportunités ou de dysfonctionnements du marché des taux d'intérêt. Le Portefeuille d'obligations est en particulier exposé à troisde rendement, à savoir le portage, la dynamique et la valeur relative, par le biais de stratégies consistant à prendre des positions longues ou courtes sur des contrats à terme à long terme sur des obligations d'État à l'échelle mondiale, principalement européennes, nord-américaines et japonaises, avec des expositions variant entre -150et 150par contrat à terme.

Une réallocation automatique au sein de chaque stratégie est effectuée via l'application d'un modèle systématique d'optimisation du ratio risque/rendement, tout en visant à acquérir une sensibilité globale neutre au marché obligataire à moyen terme.

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 (y compris les TRS), conformément à une Politique de réplication synthétique.

Les investisseurs peuvent effectuer des souscriptions ou des rachats au cours de tout jour ouvrable complet des Bourses françaises, allemandes, britanniques, japonaises, canadiennes et américaines lors duquel le règlement en EUR et USD est prévu (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 16h (CET) le Jour ouvrable précédant 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

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 instruments de Taux d'intérêt. L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait qu'une hausse des taux d'intérêt a pour conséquence une diminution de la valeur des investissements en obligations et titres de créance et, plus généralement, des instruments à revenu fixe.

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 de crédit**: risque de dégradation de la signature d'un émetteur ou sa défaillance pouvant entraîner une baisse de la valeur des instruments financiers qui lui sont associés.

- **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.



**BNP PARIBAS**  
ASSET MANAGEMENT

The sustainable investor for a changing world

## 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 | 0,90% (*) |
|----------------|-----------|

### 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.

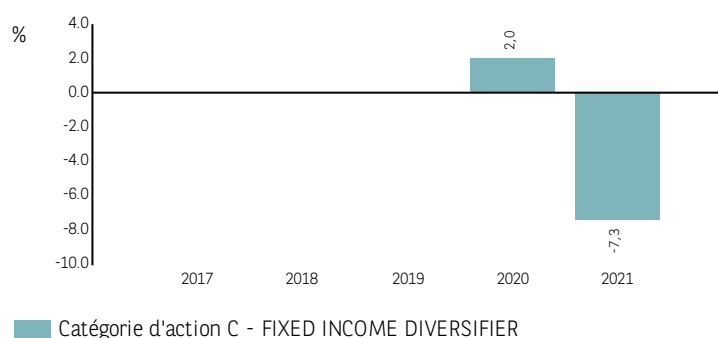
Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Il ne comprend pas :

- 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



- 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 16 décembre 2019.
- 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.



**BNP PARIBAS**  
ASSET MANAGEMENT

The sustainable investor for a changing world