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 FACTOR DEFENSIVE, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe « I USD Capitalisation » -code ISIN LU2051092851
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 sous-fonds est d'assurer la croissance du capital (i) en étant exposé à un panier d'actions américaines et (ii) en mettant en œuvre une stratégie systématique d'options qui vise à réduire le risque en minimisant la volatilité du sous-fonds.

Afin d'atteindre son objectif de placement, le sous-fonds met en œuvre une stratégie de placement quantitative (la Stratégie) qui combine deux piliers de performance :
(a) une longue exposition à un panier d'actions américaines par le biais de l'indice BNP Paribas DEFI Equity US long Net TR (l'indice de stratégie). L'univers d'investissement de l'indice de stratégie est composé des plus grandes capitalisations boursières des marchés américains offrant des conditions de liquidité satisfaisantes. L'indice de stratégie vise à sélectionner les actions selon un processus d'investissement systématique et quantitatif,
Et (b) une stratégie d'options systématiques complémentaires sur l'indice S&P 500 destinée à améliorer le rapport risque/rendement par rapport à un investissement direct dans l'indice de stratégie en prenant de longues positions sur les options de vente sur l'indice S&P 500 financées dans la mesure du possible par des positions courtes sur appelOptions de l'indice S&P 500. La stratégie des options de vente est particulièrement appropriée sur les marchés très baissier, ce qui permet au sous-fonds de limiter les effets de la chute des marchés boursiers américains et de limiter ainsi sa volatilité. La stratégie d'options d'appel est particulièrement appropriée dans les marchés stables ou relativement sans orientation.

L'indice de stratégie est basé sur un processus d'investissement systématique développé par BNP Paribas et est rééquilibré chaque mois à l'aide d'un algorithme spécifique qui vise (i) à sélectionner des actions à travers une combinaison de quatre facteurs de performance :Valeur, qualité, dynamique et faible volatilité, et (ii) de bénéficier de tels facteurs de diversification de l'investissement et (iii) de maintenir une bêta proche de 1 et une erreur de suivi ex ante inférieure à 3.5%, c.-à-d. d'atteindre une performance corrélée, en ce qui concerne l'indice de rendement total S&P 500 (code Bloomberg : Indice SPTR).
La ventilation complète de l'index de la stratégie est disponible sur le site Web : https://indx.bnpparibas.com. La méthode de calcul de l'indice est disponible directement à l'adresse suivante : https://indx.bnpparibas.com/nr/DFUTTR.pdf.
L'obtention d'une performance corrélée avec la performance de l'indice de rendement total S&P 500 peut nécessiter de l'indice de stratégie l'utilisation de l'effet de levier par une exposition supplémentaire longue ou courte aux futures. Il convient de noter que les coûts liés à la réplication et au rééquilibrage de l'indice de stratégie sont indiqués dans le jeu de règles de l'indice de stratégie.

La stratégie du sous-fonds est considérée comme active. Le sous-fonds n'a pas de référence à des fins de comparaison des performances.

La stratégie est mise en œuvre conformément à une politique de réplication synthétique par la conclusion de dérivés OTC. La politique de réplication synthétique implique que le sous-Fonds ne possède pas réellement les titres sous-jacents de la Stratégie, mais qu'il s'appuie plutôt sur des dérivés OTC pour assurer son rendement. Le sous-fonds investit en tout temps au moins 51 % de son actif net dans des actions et/ou des titres traités comme équivalents à des actions émises par des sociétés de tout pays.

Les investisseurs peuvent s'abonner ou échanger tout jour où la bourse de New York est ouverte toute la journée (sauf les samedis et dimanches et les jours fériés français et luxembourgeois).

Les demandes d'abonnement et de rachat peuvent être faites à l'agent administratif avant 12.00 h (HEC) au plus tard le jour d'évaluation concerné.

Agent administratif : BNP Paribas Securities Services, Luxembourg Branch, 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 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 influer 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	Néant
Frais de sortie	Néant
Frais prélevés par l'OPCVM chaque année	
Frais courants	0,80% (*)
Frais prélevés par l'OPCVM dans certaines circonstances spécifiques	
Commission de performance	Néant

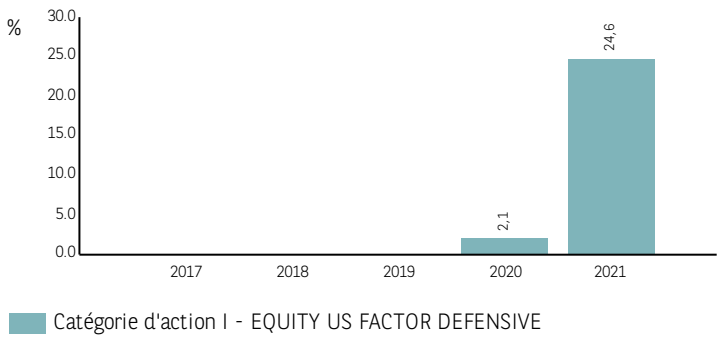
Les frais d'entrée et de sortie indiqués correspondent aux montants maximums pouvant être prélevés. Vous pouvez payer moins dans certains cas. Renseignez-vous auprès de votre conseiller financier.
(*) Le pourcentage des **frais courants** se fonde sur les dépenses passées déterminées au 31 décembre 2021.
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 USD.

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.