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 DEFI, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe "I USD Capitalisation" - ISIN code LU1480598967
Ce sous-fonds est géré par BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, qui fait partie du Groupe BNP Paribas.

Objectifs et politique d'investissement

Le Compartiment cherche à accroître la valeur de ses actifs à moyen terme en étant exposé à un panier dynamique d'actions cotées sur les marchés américains ou actives sur ces marchés, dont les composantes sont choisies à l'aide d'une méthode de sélection systématique basée sur une analyse fondamentale des sociétés.

En vue de réaliser son objectif d'investissement, le Compartiment met en œuvre une stratégie d'investissement quantitative (la Stratégie) consistant à établir des positions longues sur un panier diversifié composé d'actions des marchés américains et des positions longues ou courtes sur contrats à terme standardisés par le biais de l'indice BNP Paribas DEFI Equity US Long Net TR (l'Indice de Stratégie).
La Stratégie repose sur un processus d'investissement systématique développé par BNP Paribas et est rebalancée chaque mois par le biais d'un algorithme spécifique visant (i) à sélectionner des actions au moyen d'une combinaison de quatre facteurs de performance : valeur, qualité, dynamique et faible volatilité ; (ii) à tirer parti de cette diversification factorielle de l'investissement ; et (iii) à maintenir un bêta proche de 1 et une erreur de suivi ex ante inférieure à 3,5 % par rapport à l'indice S&P 500 Total Return (code Bloomberg : SPTR Index) par le biais d'une exposition supplémentaire aux contrats à terme standardisés.

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/DFETTR.pdf.
L'Indice de stratégie peut utiliser un effet de levier par le biais d'une exposition longue ou courte supplémentaire aux contrats à terme standardisés afin de maintenir un bêta proche de 1 par rapport à l'indice S&P 500 Net Total Return. L'effet de levier se situe au niveau de l'Indice de Stratégie. Il faut noter que la réplication et le rebalancement de l'Indice de Stratégie entraînent des frais qui sont indiqués dans le règlement de l'Indice de Stratégie.

La Stratégie du Compartiment est considérée comme active. L'indice de référence du Compartiment, utilisé à des fins de comparaison des performances, est l'indice S&P 500 Net Total Return, sans objectif de réplication 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 réplication synthétique, soit en espèces, en investissant directement dans le panier d'actions qui compose l'indice. Dans le cadre d'une telle Politique de réplication 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. 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 l'investissement effectué principalement dans des actions, dont la valeur peut varier considérablement. Ces fluctuations sontsouvent amplifiées à court terme.
Risque(s) important(s) non pris en compte dans l'indicateur dont la réalisation peut entrainer 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 influer 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	0,60%(*)
Frais prélevés par l'OPCVM dans certaines circonstances	
Commission de performance	Néant

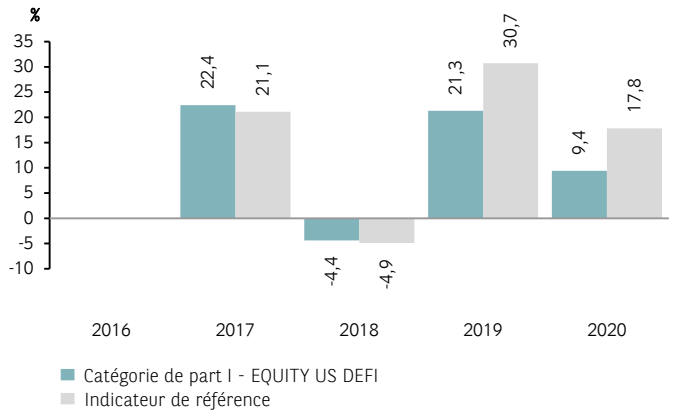
Les frais d'entrée et de sortie sont des maxima. Dans certains cas, ces frais sont moindres. L'investisseur peut obtenir de son conseil ou de son distributeur le montant effectif des frais d'entrée et de sortie.
(*) L'évaluation des frais courants se fonde sur les frais courants de l'exercice précédent 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 15 décembre 2016 ;
- 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.