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 iESG Eurozone Income Defensive, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe « I EUR Distribution » -code ISIN LU1480594545
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 des revenus et du capital (i) en étant exposé à un panier d'actions à haut dividende de l'Union économique et monétaire européenne (la «zone euro») tout en tenant compte de l'environnement,Critères sociaux et de gouvernance (ESG) et (ii) par la mise en œuvre d'une stratégie systématique d'options visant à générer des revenus supplémentaires et à réduire les risques en minimisant la volatilité dans le sous-fonds.

Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le sous-Fonds met en œuvre une stratégie d'investissement quantitative (la Stratégie) qui combine deux piliers de performance :
(A) une longue exposition à un panier d'actions de la zone euro à haut dividende (le portefeuille à haut dividende) qui comprend les étapes suivantes :
(i) la définition de l'univers d'investissement composé des principales actions à grande capitalisation de la zone euro réputées offrir des liquidités adéquates et répondre aux exigences ESG minimales selon une approche de premier ordre. Sont en particulier exclus, les entreprises impliquées dans des secteurs ayant potentiellement un impact ESG négatif élevé, ceux qui font l'objet de violations importantes des principes du Pacte mondial des Nations Unies et ceux qui ont été impliqués dans de graves controverses liées à ESG.
(ii) sélection des actions sur la base de critères fondamentaux d'évaluation, tels que le potentiel de croissance des dividendes et la qualité du modèle d'entreprise.
(iii) approche d'intégration ESG qui consiste à intégrer les scores ESG dans le modèle d'allocation en modifiant l'évaluation fondamentale susmentionnée des entreprises en fonction de leur score ESG, en favorisant les meilleurs scores ESG en fonction de critères tels que :mais sans s'y limiter, l'efficacité énergétique, le respect des droits de l'homme et des travailleurs, l'indépendance du conseil d'administration.
(iv) garantir des objectifs ESG et carbone minimaux, consistant en une empreinte carbone plus faible et une meilleure cote ESG du portefeuille final de la Stratégie par rapport à un univers d'investissement de marché de référence.
(v) mise en œuvre d'un mécanisme d'allocation visant à contrôler le risque relatif du portefeuille final par rapport au marché de référence, et en particulier le contrôle de l'erreur de suivi ex ante inférieure à 4% en ce qui concerne l'indice de rendement net euro STOXX (Code Bloomberg : SXXT).
(b) une stratégie d'options systématiques complémentaires sur l'indice Euro Stoxx 50 visant à améliorer le rapport risque/rendement par rapport à un investissement direct dans l'indice de stratégie en prenant de courtes positions sur les options d'achat sur l'indice Euro Stoxx 50 qui visent à générer des revenus supplémentaires tout en limitant les sous-fondsVolatilité et positions longues sur les options de vente sur l'indice Euro Stoxx 50 afin de réduire la volatilité du sous-fonds.

Une stratégie extra-financière peut comprendre des limites méthodologiques telles que le risque lié à l'investissement ESG ou le risque lié à une répartition systématique intégrant des critères extra-financiers.
Le portefeuille de dividendes élevés est mis en œuvre via l'utilisation de l'indice ESG de dividende de qualité BNP Paribas (l'indice de dividende élevé). Il est basé sur un algorithme quantitatif développé par BNP Paribas et est rééquilibré chaque mois à l'aide d'un algorithme spécifique. Le rééquilibrage mensuel n'implique aucun coût pour l'indice de stratégie. La ventilation complète de l'indice des dividendes élevés 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/FEDZTR.pdf

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 sera 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 le rendement de la Stratégie. Le sous-fonds investit en permanence au moins 75 % de son actif net dans des actions émises par des sociétés ayant leur siège social dans un État membre de l'espace économique européen.

Les investisseurs peuvent souscrire ou échanger tout jour où les bourses de Paris, Francfort, Amsterdam, Madrid et Milan sont ouvertes 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.
Un dividende peut être distribué.

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.
- Risque de liquidité : ce risque découle de la difficulté de vendre un actif à un cours de marché juste et au moment souhaité en raison 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 chaque année	
Frais courants	0,80% (*)
Frais prélevés par l'OPCVM dans certaines circonstances spécifiques	
Commission de performance	Néant

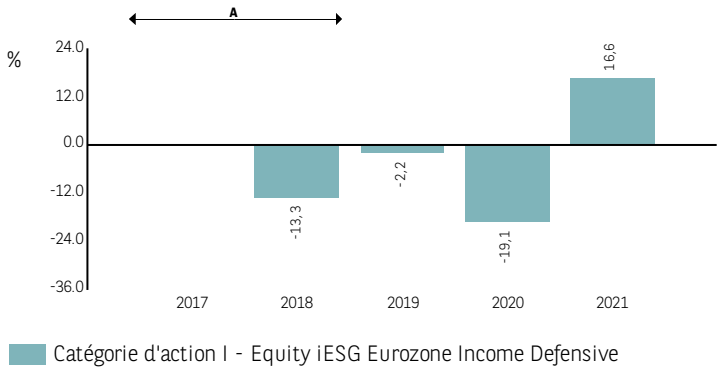
Les frais d'entrée et de sortie indiqués correspondent aux montants maximums pouvant être prélevés. Vous pouvez payer moins dans certains cas. Renseignez-vous auprès de votre conseiller financier.
(*) Le pourcentage des **frais courants** se fonde sur les dépenses passées déterminées au 31 décembre 2021.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



A: 11/2017 - 04/2018 : À la suite d'une opération sur titres le 26/04/2018, les performances indiquées intègrent la simulation des performances passées et des frais du THEAM Quant Equity Eurozone Income Defensive [I EUR DIS].

- 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 26 avril 2018.
- 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.