

# 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 Europe DEFI, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe « J EUR Capitalisation » -code ISIN LU1480601266

Ce Compartiment 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 européens 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 européens et de positions longues ou courtes sur contrats à terme standardisés par le biais de l'indice BNP Paribas DEFI Equity Europe Long Net TR (l'Indice de Stratégie).

La Stratégie repose sur un processus d'investissement systématique développé par BNP est rebalancée chaque mois par le biais d'un algorithme spécifique visant (i) à sélectionner des actions au moyen d'une combinaison de quatre 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 inférieure à 3,5 par rapport à l'indice STOXX Europe- Net Return EUR (code BloombergSXXR 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 STOXX Europe 600 Net Return EUR. L'effet de levier se situe au niveau de l'Indice de Stratégie. Il faut noter que la réplique 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 STOXX Europe- Net Return EUR, sans objectif de réplique 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 réplique synthétique, soit en espèces, en investissant directement dans le panier d'actions qui compose l'indice. Dans le cadre d'une telle Politique de réplique 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 émises par des sociétés ayant leur siège social dans un État membre de l'Espace économique européen.

Les investisseurs peuvent effectuer des souscriptions ou des rachats au cours de tout jour d'ouverture complet des Bourses en France, au Royaume-Uni, en Allemagne, en Suède, en Italie, en Suisse, en Norvège et au Danemark (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 12h CET au plus tard le jour d'évaluation concerné.

Agent administratif BNP 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 fluctuer considérablement. Ces fluctuations sont souvent amplifiées à court terme.

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 influencer 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** 0,45% (\*)

### 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.

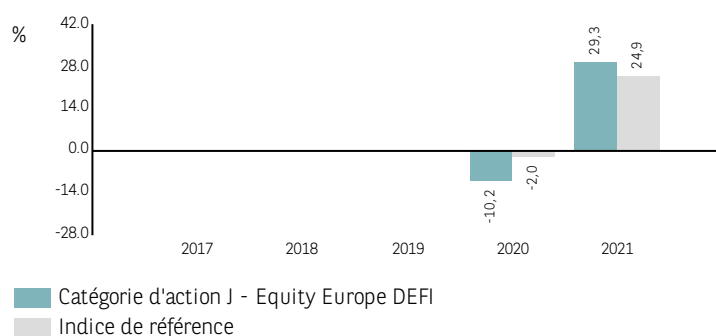
Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Il ne comprend pas :

- 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 21 mars 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.

