

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 EURO LONG DIVIDENDS, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe « I - EUR EUR Capitalisation » -code ISIN LU1893646445

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 consiste à accroître la valeur de ses actifs à moyen terme en étant exposé aux variations prévues des dividendes versés par des sociétés sélectionnées parmi celles cotées sur le marché des actions de l'Union économique et monétaire de l'Union européenne (la zone euro).

En vue de réaliser son objectif d'investissement, le Compartiment met en œuvre une stratégie d'investissement quantitative (la Stratégie) consistant à acquérir une exposition positive aux variations des dividendes versés par les sociétés qui composent l'indice EURO STOXX- (code BloombergSX5E index). La Stratégie repose sur un processus d'investissement systématique qui vise (i) à bénéficier d'une exposition synthétique longue à la performance moyenne des contrats à terme standardisés ayant une échéance d'environ unet demi sur les dividendes de l'indice EURO STOXXet (ii) à ajouter une surexposition variable à long terme, en cas de baisse significative du marché des dividendes. L'exposition augmentera à mesure que le marché des dividendes s'éloignera de la valeur maximale atteinte au cours de l'année précédente. Le Compartiment peut être surexposé à la Stratégie, dans la limite de 200de ses actifs nets. À cet égard, la Stratégie peut engendrer une exposition à la performance moyenne des contrats à terme standardisés sur les dividendes de l'indice EURO STOXX- avec des maturités d'environ unet demi et de deuxet demi permettant au Compartiment de bénéficier éventuellement de la tendance des contrats à terme standardisés à retrouver leur «intrinsèque- ».

Cette exposition aux dividendes implicites sera obtenue de manière synthétique au moyen d'instruments financiers à terme tels que des achats de swaps de dividendes. La performance du Compartiment dépendra donc principalement des variations des niveaux de dividendes implicites absolus, mais aussi, dans une moindre mesure, des niveaux réels des dividendes versés au fil des mois. L'objectif est de profiter de la tendance qu'ont les contrats à terme standardisés sur dividendes à retrouver leur «intrinsèque- », à des échéances relativement courtes.

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 EURO STOXX- Net Return, sans objectif de réplication de ce dernier.

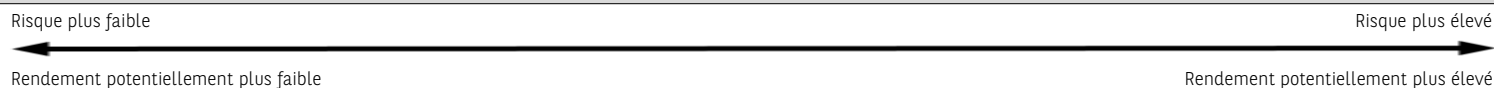
La Stratégie est mise en œuvre par la souscription d'instruments dérivés de gré à gré (y compris les TRS), conformément à une Politique de réplication synthétique. Le Compartiment investit à tout moment au moins 75de ses actifs nets dans des actions émises par des sociétés ayant leur siège social dans 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 de la Bourse de Paris (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 effectuées auprès de l'agent administratif avant 12~ CET 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



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 ».

L'investissement dans des instruments s'apparentant à des actions justifie la catégorie de risque. Ceux-ci connaissent des variations de leur cours, qui 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.
- **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	0,76% (*)
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.

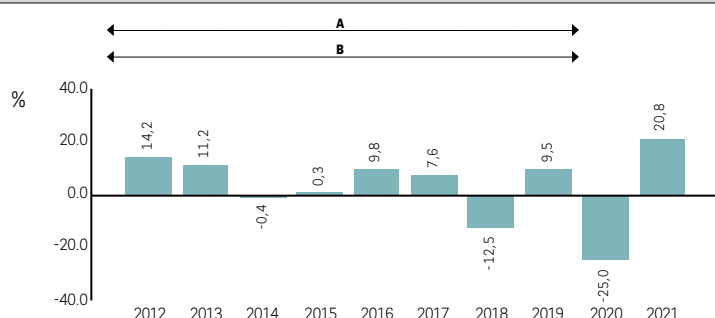
Ce chiffre peut varier d'un exercice à l'autre. Il ne comprend pas :

- 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



■ Catégorie d'action I - EUR - EQUITY EURO LONG DIVIDENDS

- A:** 04/2009 - 06/2019 : À la suite d'une opération sur titres le 21/06/2019, les performances indiquées intègrent la simulation des performances passées et des frais du THEAM Quant Euro Long Dividends [A EUR ACC].
- B:** 01/2010 - 06/2019 : À la suite d'une opération sur titres le 20/06/2019, les performances indiquées intègrent la simulation des performances passées et des frais du THEAM Euro Long-Dividends [Parts A - EUR, C].

- 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 juin 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