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 PREMIUM INCOME, un compartiment de la SICAV THEAM QUANT-

Classe « I - EUR EUR Capitalisation » -code ISIN LU1480597647
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 en mettant en œuvre une stratégie systématique d'options sur une sélection d'actions américaines qui vise à générer des revenus sur des marchés haussiers et modérément baisers. Le sous-fonds vise un revenu de 5 % par année, la réalisation de cet objectif n'est pas garantie.
Afin d'atteindre son objectif de placement, le sous-Fonds met en œuvre une stratégie de placement quantitative (la Stratégie) qui consiste à vendre des options de placement à court terme sur une sélection d'actions américaines par l'intermédiaire de l'indice BNP Paribas stock put Write US (l'indice de stratégie).

Le modèle utilisé pour établir l'indice de stratégie vise à :
- sélection mensuelle des actions (rééquilibrage) suivant un processus basé sur des critères fondamentaux et de marché. L'objectif est d'examiner l'univers des investissements afin d'identifier les actions bénéficiant d'un modèle commercial durable, d'une dynamique des prix favorable, d'une capitalisation boursière moyenne élevée, d'une faible corrélation avec les actions américaines, d'une évaluation attractive de la prime d'option et de conditions de négociation favorables sur le marché des options. L'univers d'investissement de l'indice stratégique est composé des plus grandes capitalisations boursières des États-Unis offrant des conditions de liquidité satisfaisantes.
- vendre dynamiquement, dans des proportions égales, des options de mise hors de la monnaie à court terme sur chacune des actions sélectionnées par le processus mentionné précédemment («Stratégie de mise-écriture»). Les stratégies de mise en écriture visent à généraliser les revenus tout en limitant sa volatilité globale et seront particulièrement appropriées sur les marchés haussiers et modérément baisers.

L'indice de stratégie est un indice diversifié basé sur un algorithme quantitatif développé par BNP Paribas. La ventilation complète de l'index de la stratégie est disponible sur le site Web : https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com. La méthode de calcul de l'indice est disponible directement à : https://indices-globalmarkets.bnpparibas.com/nr/SPUSTR.pdf
les investisseurs devraient noter qu'il existe des coûts de réplication annuels liés à la vente dynamique d'options de vente à court terme ainsi que des coûts supplémentaires résultant de la gestion du portefeuille de stratégies de vente d'écriture à chaque jour de rééquilibrage. Ces coûts réduiront le rendement de l'indice de stratégie et, indirectement, celui du sous-fonds.

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

Pour mettre en œuvre la Stratégie, le sous-Fonds utilise une politique de réplication synthétique par la conclusion de dérivés OTC.
La politique de réplication synthétique implique que le sous-Fonds investit soit ses actifs dans des titres transférables, soit dans des instruments du marché monétaire (les actifs de financement) et échange la performance d'un maximum de 100 % des actifs de financement par l'intermédiaire de dérivés OTC afin de s'exposer à la Stratégie. Dans le cadre de la politique de réplication synthétique, 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 souscrire 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.
Les valeurs liquidatives sont soumises au risque de variation entre la devise de référence de la classe d'actions et la devise de la stratégie.

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 la performance de l'Indice de Stratégie, qui peut fortement fluctuer à la hausse ou à la baisse et qui implique un risque de fluctuation rapide et forte de la valeur de l'investissement.
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	0,76% (*)
Frais prélevés par l'OPCVM dans certaines circonstances spécifiques	
Commission de performance	Néant

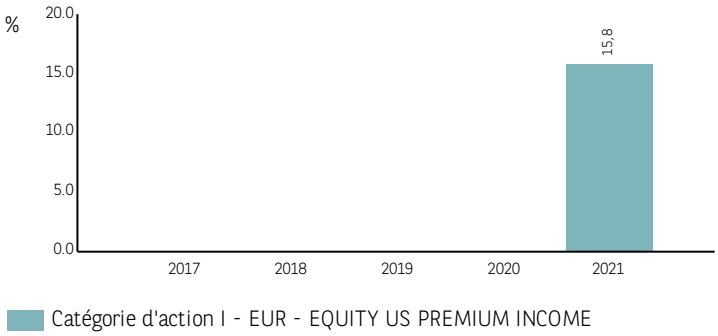
Les frais d'entrée et de sortie indiqués correspondent aux montants maximums pouvant être prélevés. Vous pouvez payer moins dans certains cas. Renseignez-vous auprès de votre conseiller financier.
(*) Le pourcentage des **frais courants** se fonde sur les dépenses passées déterminées au 31 décembre 2021.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



- 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 19 mai 2020.
- 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.
- Informations destinées aux investisseurs en Suisse : le Prospectus, le Document d'information clé pour l'investisseur, les Statuts, ainsi que les rapports annuel et semestriel, peuvent être obtenus, sans frais, auprès du représentant en Suisse, BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zurich ; l'agent payeur en Suisse est BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, 16, Selnaustrasse, 8002 Zurich.
- 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.