

Datos fundamentales para el inversor

El presente documento proporciona datos fundamentales para los inversores de este subfondo. No se trata de material de promoción comercial. La ley exige que se facilite esta información para ayudarle a comprender la naturaleza del subfondo y los riesgos que comporta invertir en él. Es aconsejable que lea el documento para poder tomar una decisión fundada sobre la conveniencia o no de invertir en él.

Equity Eurozone Factor Defensive, un subfondo de la SICAV THEAM QUANT-

Clase «I EUR Capitalisation» - Código ISIN LU1893653144

Este Subfondo está gestionado por BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, sociedad del Grupo BNP Paribas.

Objetivos y política de inversión

El objetivo del Subfondo es proporcionar crecimiento del capital (i) al estar expuesto a una cesta de valores de renta variable de la Unión Económica y Monetaria Europea (la zona euro) e (ii) implementar una estrategia de opciones sistemática que apunta a reducir el riesgo minimizando la volatilidad del Subfondo.

Para lograr su objetivo de inversión, el Subfondo implementa una estrategia de inversión cuantitativa (la «Estrategia») que combina dos pilares de rendimiento: (a) una exposición prolongada a una cesta de valores de renta variable europeos a través del BNP Paribas DEFI Equity Eurozone Long Net TR Index (el «Índice de la Estrategia»). El Índice de la Estrategia tiene como objetivo seleccionar los valores de renta variable siguiendo un proceso de inversión sistemático y cuantitativo; y (b) una estrategia de opciones sistemática complementaria en el índice EURO STOXX 50 destinada a mejorar la relación riesgo/rendimiento en comparación con una inversión directa en el Índice de la Estrategia mediante la toma de posiciones largas en las opciones de venta en el índice EURO STOXX 50, financiadas, en la medida de lo posible, mediante la toma de posiciones cortas en las opciones de compra en el índice EURO STOXX 50. La estrategia de opciones de venta es especialmente adecuada en mercados muy bajistas, lo que permite al Subfondo limitar los efectos de la caída de los mercados de renta variable europeos y, por lo tanto, limitar su volatilidad. La estrategia de opciones de compra es particularmente apropiada en mercados estables o con poca dirección.

El Índice de la Estrategia se basa en un proceso de inversión sistemático desarrollado por BNP Paribas y se reequilibra cada mes utilizando un algoritmo específico que apunta (i) a seleccionar valores de renta variable mediante una combinación de cuatro factores de rendimiento: valor, calidad, impulso y baja volatilidad; (ii) beneficiarse de la diversificación de la inversión de dichos factores y (iii) mantener una beta cercana a 1 y un error de seguimiento previo por debajo del 3,5es decir, lograr un rendimiento correlacionado con respecto al rendimiento del EURO STOXX (NR) (código Bloomberg: SXXT Index).

El desglose completo del Índice de la Estrategia está disponible en el sitio web: <https://indx.bnpparibas.com>. El método de cálculo del índice está disponible directamente en: <https://indx.bnpparibas.com/nr/BNPIDFZT.pdf>.

Lograr un rendimiento correlacionado con respecto al rendimiento del EURO STOXX (NR) puede requerir que el Índice de la Estrategia utilice el apalancamiento a través de una exposición adicional a futuros a largo o corto plazo. Cabe señalar que existen costes relacionados con la replicación y el reequilibrio del Índice de la Estrategia que se divulgan en la normativa del Índice de la Estrategia.

La Estrategia del Subfondo se considera activa. El Subfondo no tiene ningún índice de referencia para fines de comparación del rendimiento.

La Estrategia se implementa de acuerdo con una Política de replicación sintética a través de la conclusión de derivados extrabursátiles. La Política de replicación sintética implica que el Subfondo realmente no mantiene valores subyacentes de la Estrategia, sino que se basa en derivados extrabursátiles para lograr el rendimiento. El Subfondo invierte en todo momento al menos el 75de su patrimonio neto en renta variable emitida por empresas que tengan su domicilio social en un Estado miembro del Espacio Económico Europeo.

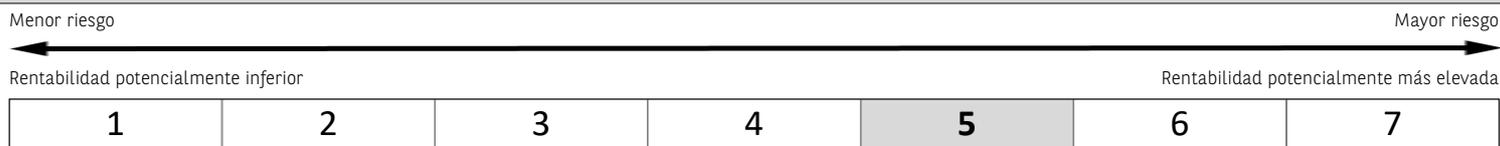
Los inversores podrán efectuar suscripciones o reembolsos los días en que las Bolsas de París, Fráncfort, Ámsterdam, Madrid y Milán estén abiertas durante todo el día (salvo sábados y domingos y los días festivos en Luxemburgo y Francia).

Las solicitudes de suscripción y reembolso pueden dirigirse al agente administrativo antes de las 12:00 horas (CET), a más tardar, en la fecha de valoración pertinente.

Agente administrativo: BNP Paribas Securities Services, Sucursal de Luxemburgo, 60 avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxemburgo, Gran Ducado de Luxemburgo.

Los ingresos se reinvierten sistemáticamente.

Perfil de riesgo y de rentabilidad



- La rentabilidad histórica (como la información utilizada para calcular el indicador sintético) no es una indicación fiable del perfil de riesgo futuro del subfondo.
- No se garantiza la categoría de riesgo asociada a este subfondo, que puede cambiar con el tiempo.

- La categoría más baja no significa «libre de riesgo».

La categoría de riesgo se justifica por la inversión en una estrategia de renta variable cuyo objetivo es reducir el riesgo y la volatilidad inducida por los valores de renta variable.

Otros riesgos que revisten una importancia significativa para el Fondo y que el indicador no capta de manera adecuada:

- **Riesgo de contraparte:** Este riesgo está relacionado con la capacidad de una contraparte de cumplir sus compromisos (como son el pago, la entrega y el reembolso) en una operación financiera extrabursátil.
- **Riesgo vinculado a la utilización de instrumentos financieros a plazo:** Utilizamos instrumentos financieros a plazo negociados fuera de la bolsa para poder replicar la rentabilidad de la estrategia. Estos instrumentos pueden implicar un conjunto de riesgos que pueden conducir a ajustes o a la propia rescisión del instrumento, lo que puede influir sobre el valor liquidativo.



Gastos

Las comisiones y los gastos sufragados se utilizan para cubrir los costes de funcionamiento del subfondo, incluidos los costes de comercialización y distribución de acciones. Estos gastos reducen el potencial de crecimiento de las inversiones.

| Gastos extraordinarios antes o después de la inversión | |
|--|-----------|
| Gastos de entrada | Nada |
| Gastos de salida | Nada |
| Gastos detraídos del OICVM a lo largo de un año | |
| Gastos corrientes | 0,80% (*) |
| Gastos detraídos del OICVM en determinadas condiciones específicas | |
| Comisiones de rentabilidad | Nada |

Los gastos de entrada y de salida mostrados son las cifras máximas. En algunos casos usted pagará menos. Puede obtener más información a través de su asesor financiero. (*) La cifra de **gastos corrientes** se basa en los gastos correspondientes pasados determinados el 31 diciembre 2021.

Dicha cifra puede variar de un año a otro. No incluye:

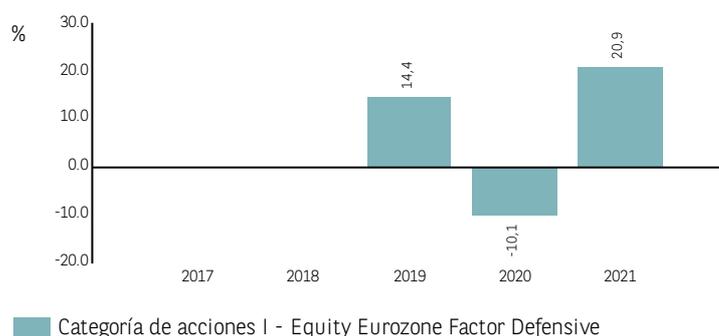
- Comisiones de intermediación.

- Los costes de intermediación, exceptuados los gastos de entrada y salida pagados por el subfondo al comprar o vender participaciones de otro organismo de inversión colectiva.

En caso de canje, se puede cobrar a los inversores una comisión máxima del 1.5%.

Si desea más información sobre los gastos, consulte el apartado «Comisiones y gastos» del folleto informativo de la SICAV, que está disponible en la siguiente dirección: <http://www.bnpparibas-am.com>.

Rentabilidad histórica



- La rentabilidad histórica no constituye un indicador de la rentabilidad futura.
- La rentabilidad se calculará neta de gastos de gestión.
- La categoría de acción se lanzó el 03 diciembre 2018.
- La rentabilidad histórica se ha calculado en EUR.

Información útil

- Depositario: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH.
- El presente documento de datos fundamentales para el inversor proporciona información sobre un subfondo de THEAM QUANT- SICAV. El folleto informativo y los informes periódicos son de aplicación a la totalidad de la SICAV que se menciona en la cabecera del documento.
- Los detalles acerca de la política de remuneración actualizada están disponibles en línea en <https://www.bnpparibas-am.com/en/footer/remuneration-policy> o previa solicitud por escrito a la sociedad gestora.
- Los inversores pueden hacer cambios entre los Fondos de THEAM QUANT-. Si desea más información, consulte el folleto informativo o póngase en contacto con su asesor financiero.
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France únicamente incurrirá en responsabilidad por las declaraciones contenidas en el presente documento que resulten engañosas, inexactas o incoherentes frente a las correspondientes partes del folleto informativo de la SICAV.
- Los documentos de datos fundamentales para el inversor del subfondo, el folleto informativo y los últimos informes anuales y provisionales se enviarán a los participantes en un plazo de ocho días hábiles tras la recepción de una solicitud por escrito a: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09.
- El precio de las acciones de la SICAV está disponible en línea en <http://www.bnpparibas-am.com>.
- Para obtener información sobre otras acciones del subfondo, consulte su folleto informativo.
- Dependiendo de su régimen fiscal, las plusvalías y los ingresos asociados a la tenencia de acciones en este subfondo pueden estar sujetos a tributación. Le recomendamos que consulte a su asesor fiscal para obtener más información al respecto.

Este Subfondo está autorizado en el Gran Ducado de Luxemburgo y regulado por la «Commission de Surveillance du Secteur Financier». Los presentes datos fundamentales para el inversor son exactos a 18 febrero 2022.

