

FINALIDAD

Este documento le proporciona información fundamental que debe conocer sobre este producto de inversión. No se trata de material comercial. Es una información exigida por ley para ayudarle a comprender la naturaleza, los riesgos, los costes y los beneficios y pérdidas potenciales de este producto y para ayudarle a compararlo con otros productos.

PRODUCTO

Equity World Global Goals, un subfondo de THEAM QUANT-, clase de acciones: I Capitalisation (LU1685644657)

Productor: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France («BNPP AM France»)

Sitio web: <https://www.bnpparibas-am.com>

Número de teléfono: llame al +33.1.58.97.13.09 para obtener más información.

La Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) es responsable de supervisar el Producto. BNPP AM France está autorizada en Francia y regulada por la Autorité des marchés financiers ("AMF").

Fecha de elaboración de este documento: 30/07/2023

¿QUÉ ES ESTE PRODUCTO?

Tipo

Este producto es un organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios (OICVM) Es un subfondo de THEAM QUANT-, una sociedad de inversión de capital variable (société d'investissement à capital variable o SICAV) regida por lo dispuesto en la parte I de la Ley de 17 de diciembre de 2010 relativa a los organismos de inversión colectiva, así como por la Directiva 2009/65 sobre OICVM.

Plazo

Este Producto no tiene fecha de vencimiento.

BNPP AM France no tiene derecho a extinguir el producto de forma unilateral. El Consejo de Administración puede decidir sobre las fusiones, las escisiones y la liquidación o el cierre del subfondo. Además, se podrá liquidar la SICAV si se decide en una junta general extraordinaria de accionistas.

Objetivos

El objetivo del Subfondo es aumentar el valor de sus activos a medio plazo mediante la exposición a una cesta dinámica de valores de renta variable cotizados en mercados desarrollados mundiales, cuyos componentes se eligen mediante un método de selección sistemática basado en i) criterios medioambientales, sociales y de gobernanza (ESG), ii) la contribución a los 17 objetivos de desarrollo sostenible (los ODS) adoptados el 25 de septiembre de 2015 por la Asamblea General de las Naciones Unidas y especialmente diseñados para poner fin a la pobreza, proteger el planeta y reducir la desigualdad, y iii) la solidez financiera de las empresas.

Para alcanzar su objetivo de inversión, el Subfondo implementa una estrategia de inversión cuantitativa (la «Estrategia») que adopta posiciones largas en una cesta diversificada compuesta por valores de renta variable de mercados desarrollados mundiales a través del BNP Paribas Equity Global Goals World NTR Index (el «Índice de la Estrategia»).

El universo de inversión está compuesto por acciones de empresas de todo el mundo seleccionadas según su puntuación de ESG que no participen en actividades cuestionables o controvertidas críticas y que muestran una baja implicación en las actividades del sector del carbón, petróleo y gas, y que, además, son (i) prácticas no continuadas o (ii) prácticas transitorias que, en general, se consideran no sostenibles. La aplicación de los criterios ESG como, entre otros, la eficiencia energética, el respeto de los derechos humanos y de los trabajadores o la independencia del consejo de administración, sigue un enfoque selectivo y de «mejor en su clase». Este tiene como objetivo seleccionar las principales sociedades de su sector excluyendo, al menos, un tercio de los valores del universo de inversión inicial. Además, dichas sociedades deberán cumplir unas condiciones de liquidez satisfactorias y unos criterios de solidez financiera favorables.

Posteriormente, el Índice de la Estrategia implementa un enfoque de inversión en ODS. Las ponderaciones de los componentes del Índice de la Estrategia se determinan en función de un algoritmo de optimización que maximiza la ponderación agregada de las acciones que se consideran de tipo «mejor de su clase» en lo que respecta a su contribución a los ODS, a través de su participación en productos sostenibles o su progresión y comportamiento sostenibles al respecto. Esta optimización del Índice de la Estrategia se aplica con arreglo a las principales restricciones de mitigación de riesgos, incluido un error de seguimiento previo inferior al 3 % con respecto al STOXX Global 1800 Net TR USD Index (código Bloomberg: SXW1V Index), y a la diversificación sectorial y geográfica.

Una estrategia extrafinanciera puede incluir limitaciones metodológicas como el riesgo relacionado con la inversión de ESG o el riesgo relacionado con una asignación sistemática que incorpora criterios extrafinancieros.

El Índice de la Estrategia se basa en un modelo sistemático desarrollado por BNP Paribas y se reequilibra de forma trimestral utilizando un algoritmo de optimización.

El Índice de la Estrategia se basa en un modelo sistemático desarrollado por BNP Paribas y se reequilibra mensualmente utilizando un algoritmo específico. El reequilibrio del Índice de la Estrategia no implica ningún coste para el mismo. Para obtener más información sobre el Índice de la Estrategia, se invita a los inversores a consultar el siguiente sitio web: <https://indx.bnpparibas.com>. El desglose completo de este Índice de la Estrategia y la información de rendimiento están disponibles en el mismo sitio web. El método de cálculo del índice está disponible directamente en: <https://indx.bnpparibas.com/nr/BNPIGGWN.pdf>.

La estrategia del Subfondo se considera activa. El índice de referencia del Subfondo es el STOXX Global 1800 Net Return Index USD sin ningún objetivo de reproducirlo.

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 del Índice de la Estrategia, sino que se basa en derivados extrabursátiles para lograr la rentabilidad.

El Subfondo invierte en todo momento al menos el 75 % del patrimonio neto en renta variable emitida por empresas que tengan su domicilio social en un Estado miembro del EEE, que no sea un país no cooperativo en la lucha contra el fraude y la evasión fiscal.

Los inversores podrán efectuar suscripciones o reembolsos cualquier día en que las bolsas de valores estén abiertas durante todo el día en Francia, Reino Unido, Alemania, Suecia, Italia, Suiza, Países Bajos, Estados Unidos, Japón y Australia (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 16:00 horas (CET), a más tardar, el día anterior a la fecha de valoración correspondiente.

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

Los ingresos se reinvierten sistemáticamente.



Inversor minorista al que va dirigido

Este producto está diseñado para inversores minoristas que no tengan experiencia financiera ni conocimientos específicos para comprender el producto, pero que, no obstante, puedan soportar una pérdida total del capital. Es adecuado para clientes que quieran revalorizar su capital mediante la inversión. Los inversores potenciales deben tener un horizonte de inversión de al menos 5 años.

Información práctica

- Depositario: BNP PARIBAS, Luxembourg Branch
- Este documento de datos fundamentales se ha elaborado para la clase de acciones o participaciones susodicha y proporciona información sobre un subfondo de THEAM QUANT- Funds. El folleto y los informes periódicos que se emiten a nivel de la SICAV incluyen más información sobre el producto. Según la legislación luxemburguesa, el pasivo está segregado entre los subfondos, lo que significa que los activos del subfondo no estarán disponibles para atender una reclamación de un acreedor u otro tercero contra otro subfondo.
- Los inversores pueden hacer cambios entre los subfondos de la SICAV. Si desea más información, consulte el folleto informativo o póngase en contacto con su asesor financiero.
- Se puede obtener más información sobre el Producto, incluido el folleto más reciente, el documento de información clave, los valores liquidativos, los últimos precios de las acciones publicados, el informe anual y la descripción de la inversión, de forma gratuita en BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - Customer Service - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, Francia.

¿QUÉ RIESGOS CORRO Y QUÉ PODRÍA OBTENER A CAMBIO?

Indicador de riesgo



El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo 4 en una escala de 7, que se traduce en un riesgo medio. La categoría de riesgo se debe a que se invierte principalmente en valores y acciones, cuyo valor puede fluctuar considerablemente. A menudo, estas fluctuaciones son mayores a corto plazo.

Tenga en cuenta el riesgo cambiario. Si la moneda de su cuenta es diferente de la moneda de este Producto, los pagos que reciba dependerán del tipo de cambio entre las dos monedas. Este riesgo no se tiene en cuenta en el indicador anterior.

Otros riesgos de importancia significativa para el Producto no incluidos en el indicador resumido de riesgo:

- 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 al uso de instrumentos financieros a plazo: Estos instrumentos pueden implicar una serie de riesgos que pueden afectar al valor liquidativo.

Para obtener más información sobre los riesgos, consulte el folleto.

Este Producto no incluye ninguna protección frente a la evolución futura del mercado, por lo que podría perder parte o la totalidad de su inversión.

Escenarios de rentabilidad

Las cifras presentadas incluyen todos los costes del producto propiamente dicho, pero es posible que no incluyan todos los costes que usted deba pagar a su asesor o distribuidor. Las cifras no tienen en cuenta su situación fiscal personal, que también puede influir en la cantidad que reciba. Lo que obtenga de este producto dependerá de la evolución futura del mercado, la cual es incierta y no puede predecirse con exactitud. Los escenarios desfavorable, moderado y favorable que se muestran representan ilustraciones basadas en la rentabilidad más baja y más alta, así como en la rentabilidad media, del producto o de un valor de referencia adecuado durante los últimos 10 años. Los mercados podrían evolucionar de manera muy distinta en el futuro. El escenario de tensión muestra lo que usted podría recibir en circunstancias extremas de los mercados.

	Período de mantenimiento recomendado: 5 años Inversión de ejemplo: 10.000 USD	En caso de salida después de 1 año	En caso de salida después de 5 años
Mínimo	No hay un rendimiento mínimo garantizado. Podría perder parte o la totalidad de su inversión.		
Tensión	Lo que podría recibir tras deducir los costes Rendimiento medio cada año	5.118,86 USD -48,81%	1.251,36 USD -34,01%
Desfavorable	Lo que podría recibir tras deducir los costes Rendimiento medio cada año	7.921,26 USD -20,79%	8.819,85 USD -2,48%
Moderado	Lo que podría recibir tras deducir los costes Rendimiento medio cada año	10.653,33 USD 6,53%	13.311,64 USD 5,89%
Favorable	Lo que podría recibir tras deducir los costes Rendimiento medio cada año	15.686,15 USD 56,86%	18.226,25 USD 12,76%

Los siguientes escenarios se produjeron para una inversión que utiliza un valor sustitutivo adecuado. El escenario favorable se produjo para una inversión entre 2016 y 2021.

El escenario moderado se produjo para una inversión entre 2015 y 2020.

El escenario desfavorable se produjo para una inversión entre 2021 y 2023.



¿QUÉ PASA SI BNPP AM FRANCE NO PUEDE PAGAR?

La SICAV está constituida como una entidad independiente de BNPP AM France.

En caso de incumplimiento de BNPP AM France, los activos de la SICAV bajo custodia de un banco depositario no se verán afectados.

En caso de incumplimiento del banco depositario, la SICAV corre un menor riesgo de pérdida financiera porque los activos del depositario y los del producto o la SICAV están segregados por ley.

¿CUÁLES SON LOS COSTES?

La persona que le asesore sobre este Producto o se lo venda puede cobrarle otros costes. En tal caso, esa persona le facilitará información acerca de estos costes y de la incidencia que tienen en su inversión.

Costes a lo largo del tiempo

Los cuadros muestran los importes que se deducen de su inversión para cubrir diferentes tipos de costes. Estos importes dependen de cuánto invierte y de cuánto tiempo mantiene el Producto. Los importes indicados aquí ilustran un ejemplo de inversión de una determinada cuantía durante diferentes períodos de inversión posibles.

Hemos partido de los siguientes supuestos:

- El primer año recuperaría usted el importe invertido (rendimiento anual del 0%). En relación con los demás períodos de mantenimiento, hemos supuesto que el Producto evoluciona tal como muestra el escenario moderado.
- Se invierten 10.000 USD.

En caso de salida después de 1 año En caso de salida después de 5 años

Costes totales	82 USD	554,8 USD
Incidencia anual de los costes (*)	0,82%	0,87%

(*) Refleja la medida en que los costes reducen su rendimiento cada año a lo largo del período de mantenimiento. Por ejemplo, muestra que, en caso de salida al término del período de mantenimiento recomendado, el rendimiento medio que se prevé que obtendrá cada año será del 6,76% antes de deducir los costes y del 5,89% después de deducir los costes.

Composición de los costes

Costes únicos de entrada o salida	En caso de salida después de 1 año	
Costes de entrada	No cobramos comisión de entrada.	0 USD
Costes de salida	No cobramos comisión de salida.	0 USD
Costes corrientes [detráídos cada año]		
Comisiones de gestión y otros costes administrativos y de funcionamiento	0,77% del valor de su inversión al año. El porcentaje de gastos corrientes se basa en gastos históricos calculados a 31/12/2022.	77 USD
Costes de operación	0,05% del valor de su inversión al año. Se trata de una estimación de los costes en que incurrimos al comprar y vender las inversiones subyacentes del Producto. El importe real variará en función de la cantidad que compremos y vendamos.	5 USD
Costes accesorios detráídos en condiciones específicas		
Comisiones de rendimiento	No se aplica ninguna comisión de rendimiento a este producto.	0 USD

En caso de canje, se puede cobrar a los inversores una comisión máxima del 1,50%.

¿CUÁNTO TIEMPO DEBO MANTENER LA INVERSIÓN, Y PUEDO RETIRAR DINERO DE MANERA ANTICIPADA?

Período de mantenimiento recomendado: 5 años.

El período de mantenimiento recomendado se ha definido con base en el perfil de riesgo y remuneración del producto.

Los inversores pueden efectuar rescates diariamente (en días hábiles bancarios) y la orden de rescate se ejecutará de acuerdo con el calendario descrito en el folleto.

Cualquier reembolso que se produzca antes del final del período de mantenimiento recomendado puede perjudicar al perfil de rentabilidad del PRIIP.

¿CÓMO PUEDO RECLAMAR?

Si tiene cualquier reclamación, póngase en contacto con su asesor habitual en la entidad que le haya informado sobre el producto. También puede ponerse en contacto con BNPP AM France a través de su sitio web www.bnpparibas-am.fr (en la sección que aparece a pie de página dedicada a la política de gestión de reclamaciones) o enviar una carta certificada con acuse de recibo a BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - Client Service - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, Francia, o enviando un correo electrónico a amfr.reclamations@bnpparibas.com.

OTROS DATOS DE INTERÉS

■ Para consultar las rentabilidades históricas del Producto, siga las instrucciones que se indican a continuación:

- (1) Haga clic en <https://www.bnpparibas-am.fr>
- (2) En la página de bienvenida, deje seleccionado «France» (Francia) como país y elija el idioma y su perfil de inversor; acepte los términos y las condiciones del sitio web.
- (3) Diríjase a la pestaña «FUNDS» (Fondos) y haga clic en «Fund explorer» (Buscador de fondos).
- (4) Busque el Producto mediante el código ISIN o el nombre del Producto y haga clic en el Producto.
- (5) Haga clic en la pestaña «Performance» (Rentabilidad).

■ Este diagrama que figura en el sitio web muestra la rentabilidad del Producto como pérdida o ganancia porcentual anual durante los últimos 5 años frente a su valor de referencia. Puede ayudarle a evaluar cómo se ha gestionado el Producto en el pasado y a compararlo con su valor de referencia.

