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.

Europe Target Premium, un subfondo de la SICAV THEAM QUANT-

Clase «I EUR Distribution» - Código ISIN LU2051090137
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 ingresos y un crecimiento del capital mediante la aplicación de una estrategia de opciones sistemática y dinámica con base en el EURO STOXX 50 Index (código Bloomberg: SX5E Index). Dicha estrategia responde al propósito de generar ingresos en mercados alcistas y moderadamente bajistas, a la vez que se limitan las posibles detracciones del Subfondo.

Para lograr su objetivo de inversión, el Subfondo implementa una estrategia de inversión dinámica diaria (la Estrategia) que combina dos pilares de rentabilidad:

(a) una exposición corta a opciones de venta «fuera de dinero» (out-of-the-money) a corto plazo en el Euro Stoxx 50 Index (código Bloomberg: SX5E Index). Esta estrategia de opciones permite que el Subfondo genere ingresos y se emplea especialmente en mercados alcistas, estables o con poca dirección, pero es posible que genere pérdidas durante fases súbitas de fuerte detracción.

(b) una exposición dinámica corta a futuros en el Euro Stoxx 50 Index (código Bloomberg: SX5E Index). Esta estrategia se activará únicamente cuando los mercados caigan significativamente y tiene como objetivo limitar los efectos de dichas caídas de los mercados. Por ende, supone una restricción a la volatilidad del Subfondo y resulta apropiada en mercados particularmente bajistas.

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

La Estrategia se implementa de acuerdo con una Política de replicación sintética a través de la conclusión de derivados extrabursátiles (TRS incluidos).

Los inversores podrán suscribirse o reembolsar cualquier día en que la Bolsa de París esté abierta 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.
Se puede distribuir un dividendo.

Perfil de riesgo y de rentabilidad

Menor riesgo — Mayor riesgo

Rentabilidad potencialmente inferior — Rentabilidad potencialmente más elevada

1	2	3	4	5	**6**	7

- 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 el grado de rentabilidad de la Estrategia, que puede subir o bajar significativamente, lo que implica posibles cambios rápidos y drásticos en el valor de la inversión.
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	0,76% (*)
Gastos detraídos del OICVM en determinadas condiciones específicas	
Comisiones de rentabilidad	Nada

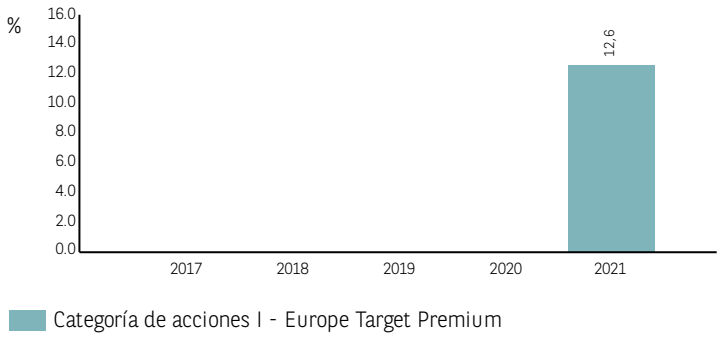
Los gastos de entrada y de salida mostrados son las cifras máximas. En algunos casos usted pagará menos. Puede obtener más información a través de su asesor financiero.
(*) La cifra de **gastos corrientes** se basa en los gastos correspondientes pasados determinados el 31 diciembre 2021.
Dicha cifra puede variar de un año a otro. No incluye:

- Comisiones de rentabilidad.
- 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 20 marzo 2020.
- 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 partícipes 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 París 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 31 agosto 2022.