

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.

BOND EUROPE CLIMATE CARBON OFFSET PLAN, un subfondo de la SICAV THEAM QUANT-

Clase «I EUR Capitalisation» - Código ISIN LU2051095011

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 (i) aumentar el valor de sus activos a medio plazo mediante la exposición a una cesta dinámica de bonos corporativos europeos con grado de inversión, cuyos componentes se eligen mediante un método de selección sistemático basado en criterios medioambientales, sociales y de gobernanza (ESG), así como según criterios de emisión de carbono y transición energética; además, el Subfondo también busca (ii) compensar su huella de carbono (alcances 1 y 2).

Para lograr su objetivo de inversión, el Subfondo implementa una estrategia de inversión cuantitativa (la «Estrategia») a través del BNP Paribas Bond Europe Climate Care Index TR (el «Índice de la Estrategia»). El universo de inversión está compuesto por sociedades europeas seleccionadas en función de su Puntuación de ASG, restricciones de liquidez, puntuación de transición energética y criterios de solidez financiera. La aplicación de los criterios ASG 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, el 20 % de los valores del universo de inversión inicial. A continuación, el algoritmo de asignación sigue un enfoque de inversión temática para tratar de maximizar la puntuación de transición energética de la cesta de bonos resultante con las principales restricciones de mitigación de riesgos y una huella de carbono inferior o igual al 50 % de la huella de carbono de un universo de inversión de referencia europeo. Paralelamente, se realiza un control de la desviación de la cartera en comparación con una cartera representativa del mercado europeo de bonos con grado de inversión, con el objetivo de obtener un error de seguimiento controlado máximo del 2 %.

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 trimestralmente utilizando un algoritmo específico. La rentabilidad del Índice de la Estrategia (e indirectamente la del Subfondo) se verá reducida por un coste de reproducción anual vinculado al reajuste trimestral, así como por las comisiones de innovación y los costes de liquidez equivalentes al 0,60 % anual, aplicados a la exposición a la Estrategia (es decir, aproximadamente el 100 % del VL del Subfondo). El desglose completo del Índice de la Estrategia está disponible en el sitio web: <https://indx.bnpparibas.com>. El método de cálculo del índice puede consultarse directamente en: <https://indx.bnpparibas.com/nr/BNPIBEC.pdf>. La Sociedad Gestora implementa de la siguiente manera una compensación de la huella de carbono mediante el uso de un tipo de créditos de carbono, conocida como la reducción verificada de las emisiones (VER, por sus siglas en inglés): la Sociedad Gestora calcula la huella de carbono (alcances 1 y 2) utilizando la composición de los activos subyacentes del Subfondo con el fin de establecer la cantidad de VER necesaria para compensar las emisiones de carbono. Todas las VER adquiridas en las que se haya logrado la compensación se cancelarán para materializar la compensación efectiva. La lista de proyectos subyacentes de VER seleccionados por la Sociedad Gestora, así como su descripción, están disponibles en: <https://docfinder.bnpparibas-am.com/api/files/4E0A58B3-05C7-4008-86CE-FDB947DD5919>.

La Compensación de la huella de carbono puede considerarse parcial en la medida en que (i) la Sociedad Gestora no tenga en cuenta el alcance 3, y (ii) solo compensa las emisiones de carbono relacionadas con la composición del Índice de la Estrategia y no las relacionadas con los instrumentos financieros mantenidos en los activos del Fondo cuando se utiliza una Política de replicación sintética.

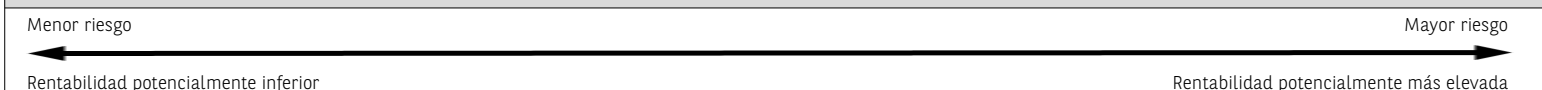
La Estrategia del Subfondo se considera activa. El Subfondo no tiene ningún índice de referencia para fines de comparación del rendimiento. La Estrategia se implementa de acuerdo con una Política de replicación sintética a través de la conclusión de derivados extrabursátiles (incluidos los TRS), o bien en efectivo, invirtiendo directamente en la cesta de bonos corporativos que conforman la Estrategia.

Los inversores podrán efectuar suscripciones o reembolsos cualquier día en que la Bolsa de Londres, la Bolsa de Nueva York y el sistema TARGET (Sistema automatizado transeuropeo de transferencia urgente para la liquidación bruta en tiempo real) estén abiertos durante todo el día (excepto los 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



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 debe a que se invierte principalmente en instrumentos de tipos de interés. Se recuerda al inversor que una subida de los tipos de interés conlleva una caída del valor de las inversiones en bonos e instrumentos de deuda y, de forma más general, instrumentos de renta fija.

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 de crédito:** riesgo de deterioro de la firma de un emisor o de su incumplimiento que puede comportar una reducción del valor de los instrumentos financieros asociados a él.
- 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.
- Riesgo de liquidez:** Este riesgo surge de la dificultad de vender un activo a un precio razonable de mercado y en el momento deseado, debido a la falta de compradores.



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

The sustainable investor for a changing world

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	0,58% (*)
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 Sociedad gestora utiliza una parte de los gastos de gestión para compensar la huella de carbono del Subfondo.

(*) La cifra que aquí se muestra en relación con los gastos corrientes constituye una estimación de dichos gastos. Debido a un cambio reciente de la estructura de comisiones, se utiliza un estimado en lugar de una cifra determinada.

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

- Los datos disponibles resultan insuficientes para obtener una indicación útil acerca de la rentabilidad histórica.
- La categoría de acción se lanzó el 15 abril 2021.

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 25 julio 2022.

