

Βασικές πληροφορίες για τους επενδυτές

Το παρόν έγγραφο παρέχει βασικές πληροφορίες για τους επενδυτές σε αυτό το επενδυτικό τμήμα. Δεν αποτελεί διαφημιστικό υλικό. Οι πληροφορίες απαιτούνται από τον νόμο, προκειμένου να σας βοηθήσουν να κατανοήσετε τη φύση και τους κινδύνους της επένδυσής σε αυτό το επενδυτικό τμήμα. Σας συμβουλεύουμε να το διαβάσετε, ούτως ώστε να αποφασίσετε εάν θα επενδύσετε έχοντας γνώση των πραγμάτων.

Equity Europe Climate Care Protection 90%, ένα Επενδυτικό Τμήμα της Ε.Ε.Μ.Κ. (SICAV) THEAM QUANT-

Κατηγορία «Protected C EUR Capitalisation» - Κωδικός ISIN LU2051101272

Αυτό το Επενδυτικό Τμήμα αποτελεί αντικείμενο διαχείρισης από την BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, μέλος του ομίλου BNP Paribas Group

Στόχοι και επενδυτική πολιτική

Το Επενδυτικό Τμήμα έχει ως στόχο την αύξηση της αξίας των των στοιχείων ενεργητικού του σε μεσοπρόθεσμο ορίζοντα μέσω της έκθεσής του σε ένα δυναμικό καλάθι μετοχών που είναι εισηγμένες σε ευρωπαϊκές αγορές ή δραστηριοποιούνται σε αυτές τις αγορές, τα συστατικά στοιχεία των οποίων επιλέγονται μέσω μιας συστηματικής μεθόδου επιλογής βάσει περιβαλλοντικών, κοινωνικών και σχετικών με τη διακυβέρνηση (ΠΚΔ) κριτηρίων, καθώς και κριτηρίων εκπομπών άνθρακα και ενεργειακής μετάβασης, και τη διανομή ετήσιου τοκομεριδίου 1% για τις κατηγορίες μεριδίων διανομής (η διανομή του ποσού αυτού δεν είναι εγγυημένη). Επιπροσθέτως, το Επενδυτικό Τμήμα επωφελείται από έναν μηχανισμό προστασίας του Εγγυητή, κατά τον οποίο, κάθε Ημέρα αποτίμησης, η καθαρή αξία ενεργητικού ανά μερίδιο εκάστης κατηγορίας ανέρχεται τουλάχιστον στο ενενήντα τοις εκατό (90%) της καθαρής αξίας ενεργητικού αναφοράς ανά μερίδιο εκάστης των κριτηρίων ενεργειακής μετάβασης του καλαθιού μεριδίων που προκύπτει. Η εν λόγω βελτιστοποίηση εφαρμόζεται σύμφωνα με τους κύριους περιορισμούς του μετριασμού των κινδύνων, συμπεριλαμβανομένου ενός προβλεπόμενου σφάλματος παρακολούθησης κάτω του 5% όσον αφορά τον δείκτη Stoxx Europe 600 Net Return EUR (κωδικός Bloomberg: SXXR Index) και αποτυπώματος άνθρακα μικρότερου ή ίσου με το 50% του αποτυπώματος άνθρακα ενός ευρωπαϊκού επενδυτικού φάσματος αναφοράς. Η Στρατηγική μπορεί να εκτίθεται σε μετοχές που δεν περιλαμβάνονται στον δείκτη Stoxx Europe 600 Net Return EUR.

Για την επίτευξη του επενδυτικού του στόχου, το Επενδυτικό Τμήμα υλοποιεί μια ποσοτική επενδυτική στρατηγική (τη Στρατηγική) που παρέχει έκθεση στις επιδόσεις ενός καθαθιού ρευστών ευρωπαϊκών εταιρειών που ενσωματώνουν υψηλά ΠΚΔ πρότυπα, όπως, ενδεικτικά, η ενεργειακή απόδοση, ο σεβασμός των ανθρωπίνων δικαιωμάτων και των δικαιωμάτων των εργαζομένων, η ανεξαρτησία των σχετικών με τη διακυβέρνηση (ΠΚΔ) κριτηρίων, καθώς και κριτηρίων εκπομπών άνθρακα και ενεργειακής μετάβασης, και τη διανομή ετήσιου τοκομεριδίου με τον άνθρακα, το πετρέλαιο και το φυσικό αέριο και οι οποίες (i) είτε δεν συνεχίζονται είτε (ii) είναι σε φάση σταδιακής κατάργησης πρακτικών που θεωρούνται ευρέως μη βιώσιμες.

Στη συνέχεια, ο αλόγισμος κατανομής ακολουθεί μια θεματική επενδυτική προσέγγιση, η οποία αποδίδει τη βέλτιστη βαρύτητα σε κάθε μερίδιο του επενδυτικού φάσματος με τρόπο αποσκοπεί στη μεγιστοποίηση των κριτηρίων ενεργειακής μετάβασης του καλαθιού μεριδίων που προκύπτει. Η εν λόγω βελτιστοποίηση εφαρμόζεται σύμφωνα με τους κύριους περιορισμούς του μετριασμού των κινδύνων, συμπεριλαμβανομένου ενός προβλεπόμενου σφάλματος παρακολούθησης κάτω του 5% όσον αφορά τον δείκτη Stoxx Europe 600 Net Return EUR (κωδικός Bloomberg: SXXR Index) και αποτυπώματος άνθρακα μικρότερου ή ίσου με το 50% του αποτυπώματος άνθρακα ενός ευρωπαϊκού επενδυτικού φάσματος αναφοράς. Η Στρατηγική μπορεί να εκτίθεται σε μετοχές που δεν περιλαμβάνονται στον δείκτη Stoxx Europe 600 Net Return EUR.

Μια μη χρηματοοικονομική στρατηγική μπορεί να περιλαμβάνει μεθοδολογικούς περιορισμούς, όπως ο Κίνδυνος που σχετίζεται με τις επενδύσεις βάσει ΠΚΔ κριτηρίων ή ο Κίνδυνος που σχετίζεται με συστηματική κατανομή που ενσωματώνει εξωχρηματοοικονομικά κριτήρια.

Η Στρατηγική εφαρμόζεται μέσω της χρήσης του χρηματοοικονομικού δείκτη BNP Paribas Equity Climate Care Europe NTR Index (ο Στρατηγικός Δείκτης). Βασίζεται σε ένα συστηματικό μοντέλο που αναπτύχθηκε από την BNP Paribas και αναπροσαρμόζεται σε τριμηνιαία βάση σύμφωνα με συγκεκριμένο αλγόριθμο. Η αναπροσαρμογή του Στρατηγικού Δείκτη δεν συνεπάγεται κανένα κόστος για τον Στρατηγικό Δείκτη.

Για περισσότερες πληροφορίες σχετικά με τον Στρατηγικό Δείκτη, οι επενδυτές μπορούν να ανατρέξουν στην ακόλουθη ιστοσελίδα: <https://indx.bnpparibas.com>. Η πλήρης ανάλυση του Στρατηγικού Δείκτη και πληροφορίες απόδοσης είναι διαθέσιμες στην ίδια ιστοσελίδα. Η μέθοδος υπολογισμού του δείκτη είναι διαθέσιμη απευθείας στη διεύθυνση: <https://indx.bnpparibas.com/nr/ECCF.pdf>.

Ο μηχανισμός προστασίας που συνδέεται με κάθε κατηγορία συνίσταται στη δημιουργία μεταβλητής έκθεσης στην απόδοση της Στρατηγικής και σε μετρητά ή μέσα της χρηματαγοράς σε βάση τουλάχιστον ίση με το επίπεδο προστασίας. Η έκθεση στη Στρατηγική καθορίζεται με την εκτέλεση κατανομής με τη χρήση ενός ποσοτικού μηχανισμού. Η έκθεση στη Στρατηγική ποικίλλει κάθε μέρα, ανάλογα τόσο με την απόδοση της Στρατηγικής όσο και με το επίπεδο προστασίας κάθε κατηγορίας.

Από την ημερομηνία έναρξής της, η κατηγορία μετοχών θα εκτίθεται στην κατανομή της ομάδας κοινών στοιχείων ενεργητικού, δηλαδή την κατανομή μεταξύ του Στρατηγικού Δείκτη (στοιχεία ενεργητικού υψηλού κινδύνου) και των μετρητών ή των μέσων χρηματαγοράς ή (στοιχεία ενεργητικού χαμηλού κινδύνου).

Η στρατηγική του Επενδυτικού Τμήματος θεωρείται ενεργή. Το Επενδυτικό Τμήμα δεν διαθέτει κάποιον δείκτη αναφοράς για σκοπούς σύγκρισης αποδόσεων.

Η Στρατηγική θα υλοποιείται είτε σύμφωνα με μια Πολιτική Συνθετικής Αναπαραγωγής, μέσω της δημιουργίας Εξωχρηματιστηριακών Παραγώγων, ή τοις μετρητοίς επενδύοντας εν μέρει άμεσα στο καλάθι μετοχών που συνθέτουν τη Στρατηγική. Η Πολιτική Συνθετικής Αναπαραγωγής προϋποθέτει ότι το Επενδυτικό Τμήμα δεν κατέχει στην πραγματικότητα τους υποκείμενους τίτλους του δείκτη, αλλά, αν' αυτού, βασίζεται στα Εξωχρηματιστηριακά Παράγωγα προκειμένου να επιτύχει εν μέρει την απόδοση του Στρατηγικού Δείκτη.

Οι επενδυτές είναι σε θέση να πραγματοποιούν εγγραφές ή εξαγορές οποιαδήποτε ημέρα κατά την οποία τα χρηματιστήρια είναι ανοικτά καθ' όλη τη διάρκεια της ημέρας στο Παρίσι, το Λονδίνο, τη Φρανκφούρτη και τη Στοκχόλμη, κατά τη διάρκεια ολόκληρης της ημέρας (εκτός από Σάββατα, Κυριακές και τις επίσημες αργίες σε Λουξεμβούργο και Γαλλία).

Αιτήματα για εγγραφές και εξαγορές υποβάλλονται στον πράκτορα διοίκησης, μέχρι τις 12:00 μ.μ. (ώρα Κεντρικής Ευρώπης) τη σχετική ημέρα αποτίμησης. Πράκτορας διοίκησης: BNP Paribas Securities Services, Luxembourg Branch, 60, avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Μεγάλο Δουκάτο του Λουξεμβούργου.

Τα έσοδα επανεπενδύονται συστηματικά.

Προφίλ κινδύνου και απόδοσης

Χαμηλότερος κίνδυνος

Υψηλότερος κίνδυνος

Τυπικά χαμηλότερη απόδοση

Τυπικά υψηλότερη απόδοση

1	2	3	4	5	6	7
---	---	---	---	---	---	---

• Οι προηγούμενες αποδόσεις, όπως οι πληροφορίες που χρησιμοποιήθηκαν για τον υπολογισμό του συνθετικού δείκτη, ενδέχεται να μην αποτελούν αξιόπιστη ένδειξη για το μελλοντικό προφίλ κινδύνου του επενδυτικού τμήματος.

• Η κατηγορία κινδύνου που συνδέεται με αυτό το επενδυτικό τμήμα δεν είναι εγγυημένη και ενδέχεται να μεταβληθεί στο μέλλον.

• Η κατώτατη κατηγορία δεν συνεπάγεται επένδυση χωρίς κινδύνους.

Η κατηγορία κινδύνου αιτιολογείται λόγω της επένδυσής κυρίως και μερίδια, η αξία των οποίων μπορεί να παρουσιάσει έντονες διακυμάνσεις. Αυτές οι διακυμάνσεις συχνά ενισχύονται βραχυπρόθεσμα.

Σημαντικοί κίνδυνοι οι οποίοι δεν λαμβάνονται υπόψη στον δείκτη και θα μπορούσαν να οδηγήσουν σε μείωση της καθαρής αξίας ενεργητικού:

• **Κίνδυνος Αντισυμβαλλόμενου:** Αυτό ο κίνδυνος συνδέεται με την ικανότητα ενός αντισυμβαλλόμενου σε μια εξωχρηματιστηριακή χρηματοοικονομική συναλλαγή να εκπληρώσει τις υποχρεώσεις του, όπως πληρωμή, παράδοση και εξόφληση.

• **Κίνδυνος συνδεδεμένος με τη χρήση προθεσμιακών χρηματοπιστωτικών μέσων:** Χρησιμοποιούμε προθεσμιακά χρηματοπιστωτικά μέσα τα οποία διακινούνται σε εξωχρηματιστηριακές αγορές προκειμένου να παρακολουθούμε την απόδοση της στρατηγικής. Τα μέσα αυτά ενδέχεται να ενέχουν μια σειρά από κινδύνους που θα μπορούσαν να οδηγήσουν σε προσαρμογές ή ακόμα και σε κλείσιμο του μέσου, γεγονός το οποίο θα επηρέαζε την καθαρή αξία ενεργητικού.

Επιβαρύνσεις

Οι επιβαρύνσεις και οι αμοιβές που καταβάλλονται χρησιμοποιούνται για την κάλυψη των εξόδων λειτουργίας του επενδυτικού τμήματος, συμπεριλαμβανομένων των εξόδων προώθησης της διάθεσης και διανομής των μεριδίων. Οι επιβαρύνσεις αυτές μειώνουν τη δυνητική απόδοση της επένδυσής σας.

Εφάπαξ επιβαρύνσεις που εισπράττονται πριν ή μετά την επένδυσή σας	
Επιβάρυνση εισόδου	3,00%
Επιβάρυνση εξόδου	Καμία
Αυτό είναι το μέγιστο που μπορεί να αφαιρεθεί από τα χρήματά σας πριν από την επένδυσή τους.	
Χρεώσεις που εισπράττονται από τον ΟΣΕΚΑ κατά τη διάρκεια ενός έτους	
Τρέχουσες επιβαρύνσεις	1,70% ^(*)
Επιβαρύνσεις που βαρύνουν τους ΟΣΕΚΑ υπό ορισμένες ειδικές συνθήκες	
Αμοιβή απόδοσης	Καμία

Οι επιβαρύνσεις εισόδου και εξόδου που εμφανίζονται είναι τα μέγιστα αριθμητικά στοιχεία. Σε ορισμένες περιπτώσεις, οι επιβαρύνσεις ενδέχεται να είναι χαμηλότερες. Σχετικές πληροφορίες μπορείτε να λάβετε από τον χρηματοοικονομικό σας σύμβουλο.

(*) Το ποσοστό των τρεχουσών επιβαρύνσεων βασίζεται σε ετήσια εκτίμηση των επιβαρύνσεων που εισπράττονται κατά τη διάρκεια του πρώτου οικονομικού έτους. Αυτό το αριθμητικό στοιχείο ενδέχεται να ποικίλλει από έτος σε έτος. Εξαιρούνται:

- ενδιάμεσες επιβαρύνσεις, εκτός από την περίπτωση επιβαρύνσεων εισόδου ή/και εξόδου που καταβάλλονται από το επενδυτικό τμήμα κατά την αγορά ή την πώληση μεριδίων σε άλλο οργανισμό συλλογικών επενδύσεων.

Σε περίπτωση μετατροπής, οι επενδυτές ενδέχεται να επιβαρυνθούν με αμοιβή ύψους 1,5% το ανώτερο.

Για περισσότερες πληροφορίες σχετικά με τις επιβαρύνσεις, ανατρέξτε στο κεφάλαιο «Επιβαρύνσεις και αμοιβές» του ενημερωτικού δελτίου του επενδυτικού τμήματος, το οποίο διατίθεται στην ιστοσελίδα www.bnpparibas-am.com.

Προηγούμενες αποδόσεις

- Η κατηγορία μετοχών τέθηκε σε κυκλοφορία την 1η Ιουλίου 2021.
- Για τον λόγο αυτόν δεν υπάρχουν επαρκή στοιχεία για την παροχή χρήσιμης ένδειξης προηγούμενων αποδόσεων.

Πρακτικές πληροφορίες

- Θεματοφύλακας: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES - ΥΠΟΚΑΤΑΣΤΗΜΑ ΛΟΥΞΕΜΒΟΥΡΓΟΥ
- Αυτό το Έγγραφο Βασικών Πληροφοριών για τους Επενδυτές (ΚΙΙΔ) περιγράφει ένα επενδυτικό τμήμα της THEAM QUANT- SICAV. Το ενημερωτικό δελτίο και οι ενδιάμεσες εκθέσεις ισχύουν για το σύνολο της SICAV που προσδιορίζεται στην κεφαλίδα του εγγράφου.
- Τα στοιχεία για την εφαρμοζόμενη πολιτική αποδοχών είναι διαθέσιμα ηλεκτρονικά στη διεύθυνση <http://www.bnpparibas-am.com/en/remuneration-disclosure> ή κατόπιν γραπτού αιτήματος προς την εταιρεία διαχείρισης.
- Οι επενδυτές μπορούν να μετακινούνται μεταξύ των Αμοιβαίων Κεφαλαίων THEAM QUANT-. Ανατρέξτε στο ενημερωτικό δελτίο ή επικοινωνήστε με τον χρηματοοικονομικό σας σύμβουλο για λεπτομέρειες.
- Η BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France μπορεί να υπέχει ευθύνη μόνο βάσει δήλωσης που περιέχεται στο παρόν έγγραφο και είναι παραπλανητική, ανακριβής ή ασυνεπής προς τα σχετικά μέρη του ενημερωτικού δελτίου της Ε.Ε.Μ.Κ.
- Το Έγγραφο Βασικών Πληροφοριών για τους Επενδυτές (ΚΙΙΔ) του επενδυτικού τμήματος, το ενημερωτικό δελτίο και οι πιο πρόσφατες ετήσιες και ενδιάμεσες εκθέσεις θα σταλούν στους μεριδιούχους κατόπιν γραπτού αιτήματος στη διεύθυνση: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - MAQS CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09.
- Η τιμή των μετοχών της Ε.Ε.Μ.Κ. είναι διαθέσιμη ηλεκτρονικά στη διεύθυνση www.bnpparibas-am.com.
- Για πληροφορίες σχετικά με άλλες μετοχές του επενδυτικού τμήματος, ανατρέξτε στο ενημερωτικό δελτίο του επενδυτικού τμήματος.
- Ανάλογα με το φορολογικό σας σύστημα, τυχόν κεφαλαιακά κέρδη και εισόδημα που σχετίζονται με τη διακράτηση μετοχών σε αυτό το επενδυτικό τμήμα ενδέχεται να υπόκεινται σε φορολόγηση. Συνιστούμε να απευθυνθείτε στον φοροτεχνικό σας σύμβουλο για περισσότερες πληροφορίες σε σχέση με αυτό το θέμα.

Το παρόν Επενδυτικό Τμήμα έχει λάβει έγκριση στο Μεγάλο Δουκάτο του Λουξεμβούργου και εποπτεύεται από την «Commission de Surveillance du Secteur Financier». Οι παρούσες βασικές πληροφορίες για τους επενδυτές είναι ακριβείς στις 24 Σεπτεμβρίου 2021.