

# Wesentliche Anlegerinformationen

Gegenstand dieses Dokuments sind wesentliche Informationen für den Anleger über diesen OGAW. Es handelt sich nicht um Werbematerial. Diese Informationen sind gesetzlich vorgeschrieben, um Ihnen die Wesensart dieses OGAW und die Risiken einer Anlage in ihn zu erläutern. Wir raten Ihnen zur Lektüre dieses Dokuments, so dass Sie eine fundierte Anlageentscheidung treffen können.

## NACHHALTIGKEITSGARANT 80 (FR0014005542)

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, eine zur BNP Paribas-Gruppe gehörende Verwaltungsgesellschaft.

### Ziele und Anlagepolitik

**Anlageziel:** Das Anlageziel des FCP besteht darin, den Anteilhabern: (i) ein partielles und variables Engagement in einer Risikoanlage (nachstehend die „Risikoanlage“), das mit einem quantitativen Algorithmus bestimmt wird. Die Risikoanlage setzt sich aus Long- und/oder Short-Positionen in den verschiedenen Anlageklassen (Aktien, Anleihen) zusammen und integriert außerfinanzielle Kriterien. Die Höhe des Engagements entspricht einem vorsichtigen Verwaltungsansatz, der die Einhaltung des nachfolgend beschriebenen Schutzmechanismus ermöglicht, und (ii) einen gleitenden Schutzmechanismus zu bieten, bei dem der Nettoinventarwert mindestens 80 % des am ersten Geschäftstag jedes Monats festgestellten Nettoinventarwerts beträgt.

Angesichts des gleitenden Schutzmechanismus kann das Engagement in der Risikoanlage zwischen 0 und 150 % betragen und daher als teilweise betrachtet werden. Das Engagement in der Risikoanlage kann null betragen, und in diesem Zusammenhang besteht das Risiko einer Umstellung auf eine vorsichtige Verwaltung des FCP während eines Monats.

#### Wesentliche Eigenschaften des FCP:

Um sein Anlageziel zu erreichen, setzt der FCP Terminfinanzinstrumente ein, um von einem variablen synthetischen Engagement in der Wertentwicklung der Risikoanlage sowie von dem gleitenden Schutzmechanismus zu profitieren. Das Anlageuniversum der Risikoanlage setzt sich bei Auflegung des FCP aus Long- und/oder Short-Positionen aus zwei Anlageklassen zusammen:

Aktien (durch die Verwendung von Finanzindizes) und Staatsanleihen. Bei den für die Anlageklasse „Aktien“ verwendeten Indizes handelt es sich um diversifizierte Indizes, die vierteljährlich anhand eines systematischen Modells neu gewichtet werden und eine dynamische Anlage in einem Korb von Aktien der Eurozone, der nordamerikanischen oder der japanischen Märkte darstellen. Das Anlageuniversum der Indizes besteht aus Aktien von Unternehmen, die nach ihrem ESG-Score auf der Grundlage des von Vigeo Eiris und BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France erstellten Ratings, Liquiditätsbeschränkungen, ihres Energiewende-Ratings und ihrer Finanzkraft ausgewählt werden.

Zusätzlich wird für die Anlageklasse „Staatsanleihen“ ein Demokratie-Score auf der Grundlage der folgenden Kriterien angewendet: die Unterzeichnung internationaler ESG-Richtlinien, Standards für soziale Kriterien in Bezug auf Menschenrechte, umstrittene Waffen, Ungleichheit zwischen den Geschlechtern, Meinungsfreiheit sowie Kriterien in Bezug auf Unternehmensführung und Korruptionsbekämpfung zugunsten von politischer Stabilität und Rechtsstaatlichkeit.

Die Anwendung einer außerfinanziellen Strategie kann methodische Grenzen beinhalten, wie z. B. das Risiko in Verbindung mit der Berücksichtigung von ESG-Kriterien oder das Risiko in Verbindung mit einer systematischen Allokation, die außerfinanzielle Kriterien integriert.

Mittels eines Algorithmus werden die verschiedenen zugrunde liegenden Vermögenswerte der Risikoanlage täglich neu zugewiesen. Durch die Anwendung eines systematischen Optimierungsmodells des Risiko-Rendite-Verhältnisses, das auf Daten der Vergangenheit beruht (Wertentwicklung, Volatilität und Korrelation) wird gemäß der Verwaltungsgesellschaft eine optimale Diversifizierung erreicht. Darüber hinaus verfügt die Risikoanlage ebenfalls über einen Mechanismus zur Volatilitätskontrolle. Dieser soll die jährliche Volatilität bei einem Zielniveau von rund 12 % halten.

Der FCP profitiert auch von einem gleitenden Schutzmechanismus. Das Schutzniveau wird monatlich neu bewertet. Somit entspricht jeder Nettoinventarwert des FCP mindestens dem neu bewerteten Schutzgrad des laufenden Monats. Dieser Schutzgrad wiederum entspricht 80 % des am ersten Werktag jedes Monats beobachteten Nettoinventarwerts, mit Ausnahme des ersten Werktags jeden Monats, in dem der Nettoinventarwert mindestens 80 % des am ersten Werktag des Vormonats beobachteten Nettoinventarwerts beträgt. Der gleitende Schutzmechanismus wird also mittels eines quantitativen Mechanismus aktiviert. Er ändert sich täglich in Abhängigkeit einerseits der Wertentwicklung der Risikoanlage und andererseits der durch den gleitenden Schutzmechanismus wie zuvor erläutert erlangten Schutzgrade. Das Engagement in der Risikoanlage kann zwischen 0 und 150 % betragen und daher als teilweise betrachtet werden. Das Engagement in der Risikoanlage kann null betragen, und in diesem Zusammenhang besteht das Risiko einer Umstellung auf eine vorsichtige Verwaltung des FCP während eines Monats.

Da das Engagement in der Risikoanlage durch den Abschluss von Terminfinanzinstrumenten (einschließlich TRS) erreicht wird, kann der FCP sein Vermögen im Rahmen dieser synthetischen Nachbildung in Geldmarktinstrumente investieren und Techniken zum Zwecke der effizienten Portfolioverwaltung (vorübergehende Käufe und Verkäufe von Wertpapieren) einsetzen.

Die Strategie des FCP wird als aktiv angesehen. Der FCP hat keinen Referenzindex zu Zwecken des Performancevergleichs.

#### Sonstige Informationen:

- Einzelheiten zu den gehandelten Vermögenswerten: Der FCP investiert überwiegend in Finanzwerte (internationale Aktien, Anleihen), Einlagen, OGAW und Finanzkontrakte (Swaps)

- Empfohlener Anlagehorizont: mindestens fünf Jahre.

- Verwendung der ausschüttungsfähigen Beträge: Thesaurierung

- Häufigkeit der Berechnung des Nettoinventarwerts und Häufigkeit der Rücknahmeanträge: täglich. Der Nettoinventarwert wird an jedem Arbeitstag der Börsen in Paris, Frankfurt, New York, Tokio und Amsterdam mit Ausnahme von gesetzlichen französischen Feiertagen ermittelt und am folgenden Geschäftstag berechnet.

- Zeichnungs- und Rücknahmebedingungen: Die Zeichnungs- und Rücknahmeanträge werden von der Verwahrstelle BNP Paribas Securities Services 9, rue du Débarcadère, 93500 Pantin, Frankreich von Montag bis Freitag um 16 Uhr zusammengefasst, auf der Grundlage des Nettoinventarwerts des folgenden Geschäftstages ausgeführt und innerhalb von fünf Geschäftstagen ab dem Berechnungsdatum des Nettoinventarwerts abgewickelt oder ausgeliefert.

### Risiko- und Ertragsprofil

Geringeres Risiko

Höheres Risiko

Typischerweise geringerer Ertrag

Typischerweise höherer Ertrag

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

• Die Wertentwicklung in der Vergangenheit, wie beispielsweise die Daten zur Berechnung des synthetischen Index, ist möglicherweise kein zuverlässiger Indikator für das zukünftige Risikoprofil des FCP.

• Für die mit dem FCP verbundene Risikokategorie besteht keine Garantie und sie kann sich im Laufe der Zeit ändern.

• Die niedrigste Kategorie bedeutet nicht „risikofrei“.

• Die Risikokategorie ergibt sich aus der Verwaltung mit dem Ziel des Werterhalts des Portfolios und einer dauerhaften Absicherung.

Wesentliche Risiken, die im Indikator nicht berücksichtigt werden und zu einer Senkung des Nettoinventarwerts führen können:

• **Gegenpartei Risiko:** Dieses Risiko besteht im Zusammenhang mit der Fähigkeit der Gegenpartei im außerbörslichen Handel ihren Verpflichtungen nachzukommen, beispielsweise ihren Zahlungs-, Liefer- oder Rückzahlungsverpflichtungen.

• **Risiko im Zusammenhang mit dem Einsatz von Finanztermininstrumenten:** Wir nutzen außerbörslich gehandelte Finanztermininstrumente, um die Performance der Strategie nachzubilden. Diese Instrumente können mit einer Reihe von Risiken verbunden sein, die zu Anpassungen oder sogar zur vorzeitigen Kündigung des Instruments und damit zu einer möglichen Beeinträchtigung des Nettoinventarwerts führen können.



## Kosten

Die von Ihnen gezahlten Kosten und Gebühren werden verwendet, um die Kosten für den Betrieb des FCP, einschließlich der Kosten für Marketing und den Vertrieb von Anteilen zu decken; diese Gebühren reduzieren das potenzielle Wachstum Ihrer Anlage.

Einmalige Kosten vor und nach der Anlage	
<b>Ausgabeaufschläge</b>	entfällt
<b>Rücknahmeabschläge</b>	entfällt
Kosten, die vom OGAW im Laufe eines Jahres abgezogen werden	
<b>Laufende Kosten</b>	1,90% (*)
Kosten, die der OGAW unter bestimmten Umständen zu tragen hat	
<b>An die Wertentwicklung des</b>	entfällt

Der Ausgabeaufschlag und der Rücknahmeabschlag sind Höchstwerte. In manchen Fällen zahlen Sie möglicherweise einen geringeren Betrag. Die tatsächliche Höhe der Ausgabeaufschläge und Rücknahmeabschläge können Anleger bei ihrem Berater oder ihrem Distributor erfragen.

(\*) Der Prozentsatz der laufenden Kosten basiert auf einer annualisierten Schätzung der Gebühren, die während des ersten Geschäftsjahres durchgeführt wird.

Dieser Wert kann von Jahr zu Jahr schwanken. Nicht enthalten sind:

- An die Wertentwicklung des Fonds gebundene Gebühren.
- Vermittlungsgebühren, außer im Falle eines Ausgabeaufschlags und/oder Rücknahmeabschlags, den der FCP beim Kauf bzw. Verkauf von Anteilen in einer anderen kollektiven Kapitalanlage gezahlt hat.

Weitere Informationen über Kosten finden Sie im Abschnitt „Gebühren und Kosten“ des Verkaufsprospekts für den FCP. Dieser ist online unter <http://www.bnpparibas-am.com> verfügbar.

## Frühere Wertentwicklung

- Deswegen sind noch keine ausreichenden Daten vorhanden, um den Anlegern nützliche Angaben über die frühere Wertentwicklung zu machen.
- Der FCP wurde am 03 décembre 2021 erstellt;
- Die Anteilsklasse wurde am 03 Dezember 2021 aufgelegt.

## Praktische Informationen

- Depotbank: BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES.
- Die Einzelheiten zur aktualisierten Vergütungspolitik sind online unter <https://www.bnpparibas-am.com/en/footer/remuneration-policy> oder auf schriftliche Anfrage bei der Verwaltungsgesellschaft verfügbar.
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France kann lediglich auf der Grundlage einer in diesem Dokument enthaltenen Erklärung haftbar gemacht werden, die irreführend, unrichtig oder nicht mit den einschlägigen Teilen des Fondsprospekts konform ist.
- Die wesentlichen Anlegerinformationen, der Prospekt sowie die letzten Jahres- und Zwischenberichte des Fonds werden auf formlose schriftliche Anfrage der Anteilhaber binnen acht Geschäftstagen übermittelt. Die Anfrage ist zu richten an: BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France - CIB Sales Support - TSA 47000 - 75318 Paris Cedex 09 Frankreich.
- Der Nettoinventarwert des FCP ist unter der folgenden Adresse erhältlich: <http://www.bnpparibas-am.com>
- Weitere Informationen über andere Anteile des FCP finden Sie im Prospekt des FCP.
- Abhängig von Ihrem Steuersystem können Kapitalgewinne oder Erträge aus dem Besitz von Anteilen an diesem FCP einer Besteuerung unterliegen. Wir empfehlen Ihnen, sich für weitere Informationen zu diesem Thema an Ihren Steuerberater zu wenden.

Der Fonds ist in Frankreich zugelassen und wird durch die „Autorité des marchés financiers“ reguliert. BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France ist in Frankreich zugelassen und wird von der „Autorité des marchés financiers“ (französische Finanzmarktbehörde) reguliert.

Diese wesentlichen Informationen für den Anleger sind zutreffend und entsprechen dem Stand vom 11 Februar 2022.

