

## BNPP LOCK IN THEAM QUANT-EQUITY EUROPE CLIMATE CARE I MD DISTRIBUTION

**PREMIO POTENZIALE COMMISURATO ALLA PERFORMANCE POSITIVA A SCADENZA DEL SOTTOSTANTE**

**COD BNL:** 2036015  
**ISIN:** XS2422015078

### CHE COSA È UN BNPP LOCK IN THEAM QUANT-EQUITY EUROPE CLIMATE CARE I MD DISTRIBUTION?

Il Certificate BNPP Lock In Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution prevede il rimborso del capitale investito a scadenza, in aggiunta ad un premio, in caso di performance positiva del Sottostante a scadenza, oppure se la quotazione del Sottostante è pari o superiore ad uno dei Livelli Lock-In in almeno una delle date di valutazione intermedie (c.d. **meccanismo di Lock-In**). A scadenza, il Certificate rimborsa il capitale investito anche in caso di ribassi del Sottostante fino al livello Barriera o se il meccanismo di Lock-in è attivato; altrimenti l'investitore può incorrere in una **perdita, parziale o totale, del capitale investito**

### QUALI SONO LE CARATTERISTICHE DEL BNPP LOCK IN SU THEAM QUANT-EQUITY EUROPE CLIMATE CARE I MD DISTRIBUTION?



Alla fine di ciascun trimestre, qualora in una data di valutazione dell'evento di Lock-In la quotazione del Sottostante sia pari o superiore ad uno dei Livelli Lock-In, pari al 110%, 115% e 120% del valore iniziale del Sottostante, si attiva il meccanismo di Lock-in e a scadenza il Certificate rimborsa il capitale investito più un premio potenziale legato alla performance del Sottostante.



A scadenza, qualora il meccanismo di Lock-in sia attivato, l'investitore riceve un importo commisurato al massimo tra il più alto Livello di Lock-In attivato e la performance positiva del Sottostante a scadenza, oltre a rimborsare il capitale investito. Qualora il meccanismo di Lock-in non sia attivato e il valore del Sottostante sia inferiore al suo valore iniziale, l'investitore riceve un importo commisurato alla performance positiva del Sottostante, oltre al capitale investito. Qualora il meccanismo di Lock-in non sia attivato e il valore del Sottostante sia inferiore al suo valore iniziale, ma pari o superiore al livello Barriera, l'investitore riceve il capitale investito. Nel caso di andamento negativo del Sottostante oltre il livello Barriera e il meccanismo di Lock-in non sia attivato, l'investitore riceve un importo commisurato alla performance del Sottostante, con conseguente **perdita, totale o parziale, del capitale investito**.

### CARTA D'IDENTITÀ

DATA DI VALUTAZIONE INIZIALE	26/09/2022
DATA DI VALUTAZIONE FINALE	08/09/2027
EMITTENTE	BNP Paribas Issuance B.V.
GARANTE	BNP Paribas
CAPITALE MINIMO INVESTITO	100 euro (Valore Nominale)
SOTTOSTANTE	Fondo Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution (TCLIMA4)
BARRIERA (a scadenza)	65% del valore iniziale del Sottostante
COLLOCAMENTO	Fino al 26/09/2022 presso le filiali BNL e mediante tecniche di comunicazione a distanza. Per l'offerta fuori sede fino al 19/09/2022, fino a esaurimento plafond. Per maggiori informazioni chiama il numero (+39) 060 060 (da fisso, cellulare o dall'estero)
SEDE DI NEGOZIAZIONE	Il Certificate è ammesso alla negoziazione su EuroTLX (MTF)

Il Certificate è uno strumento finanziario a complessità molto elevata e a capitale condizionatamente protetto, ma non garantito.

Inoltre, nel caso di vendita del Certificate prima della scadenza, l'investitore potrebbe ricevere un importo inferiore rispetto a quello inizialmente investito.

## QUANTO RICEVE L'INVESTITORE A FRONTE DI 100 EURO

Investiti nella sottoscrizione del Certificate BNPP Lock In Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD DISTRIBUTION:

Date di valutazione dell'evento Lock-In <sup>1</sup>	Meccanismo Lock-in attivo	Il Certificate paga un importo pari al capitale investito moltiplicato per il maggiore fra il massimo Livello di Lock-In attivato e la performance del Sottostante a scadenza	-
08/09/2027	Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution ≥ valore iniziale e meccanismo Lock-in non attivo	Il Certificate paga un importo pari al capitale investito moltiplicato per la performance del Sottostante a scadenza	15/09/2027
	Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution < valore iniziale ma Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution ≥ Barriera e meccanismo Lock-in non attivo	Il Certificate paga 100 €	
	Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution < Barriera e meccanismo Lock-in non attivo	Il Certificate paga un importo commisurato alla performance del Sottostante con conseguente perdita, totale o parziale, sul capitale investito (<65 €)	

<sup>1</sup> 12/12/202, 10/03/2023, 12/06/2023, 11/09/2023, 11/12/2023, 11/03/2024, 10/06/2024, 10/09/2024, 10/12/2024, 10/03/2025, 10/06/2025, 10/09/2025, 10/12/2025, 10/03/2026, 10/06/2026, 10/09/2026, 10/12/2026, 10/03/2027, 10/06/2027, 08/09/2027

\* Il valore finanziario dell'investimento rimane in ogni caso immutato e pari a 100 euro. Saranno, infatti, BNL e BNP Paribas a devolvere 0,20€ a favore di Telethon ogni 100 € di Certificate acquistato.



**BNP PARIBAS**

La banca per un mondo che cambia



**BNL**  
GRUPPO BNP PARIBAS

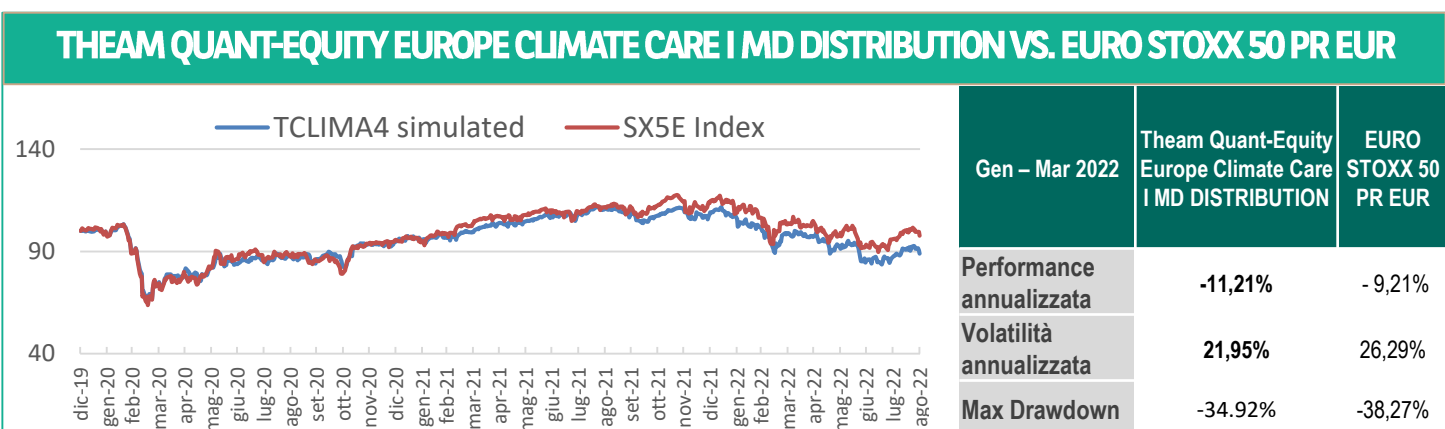
## IL FONDO

Il fondo Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution cerca di fornire una crescita del capitale nel medio periodo, legata alla performance di azioni europee con solidi standard (ESG) e selezionate in base alla relativa carbon footprint e strategia di transizione energetica. Il fondo aderisce agli standard UE Paris-aligned Benchmark e attua una strategia di investimento quantitativa tramite il fondo BNP Paribas Equity Europe Climate Care Paris-aligned NTR.

Il rendimento del fondo è dato dall'andamento di un paniere di azioni quotate o operanti nei mercati europei in cui il fondo investe, i cui dividendi netti sono reinvestiti nel fondo stesso. Si tratta di un fondo a distribuzione, che corrisponde agli investitori del fondo stesso (che non sono i detentori del Certificate), un dividendo fisso sulle azioni in cui il fondo investe pari al 4% p.a., con una frequenza mensile. Il pagamento di questo dividendo fisso ha un impatto negativo sul valore della quota (net asset value - NAV) del fondo, che viene utilizzato per determinare il rendimento del Certificate. I dividendi netti pagati dalle azioni in cui il fondo investe possono essere inferiori o superiori al dividendo fisso del 4% p.a..

## SINTESI DELLA METODOLOGIA DEL FONDO

L'universo di partenza viene definito partendo da società operanti nel mercato europeo. Vengono da subito escluse compagnie coinvolte nell'industria del carbone e in attività discutibili (alcol, tabacco, armi, pornografia, gioco d'azzardo e nucleare), come anche società con un decile ESG BNP Paribas Asset Management di 9 o 10 (10 è il decile peggiore) o con un decile Moody ESG Solutions ESG score tra il 25% più basso nel proprio settore o inferiore a 30/100 complessivi. Infine, vengono escluse le compagnie con più del 10% dei profitti provenienti da combustibili fossili o con una produzione di gas serra superiore a 100g CO<sub>2</sub> e/kWh. Il portafoglio viene ribilanciato quadrimestralmente. Ogni società ha una liquidità minima di Euro 10.000.000 e un peso massimo del 1%. Il tracking error è pari o inferiore al 5% annuo rispetto all'benchmark STOXX Europe 600 Net Return Index.



Fonte: Bloomberg, BNP Paribas. Performance di Theam Quant-Equity Europe Climate Care I MD Distribution: simulazione effettuata dal 31 Dicembre 2019 al 22 Agosto 2022, dati storici successivamente. Fondo comparativo: EURO STOXX 50 Index PR EUR Bloomberg Code: SX5E Index. Simulazioni e performance passate non sono garanzia di performance future.

### Avvertenze:

I dati relativi al Sottostante sono estrapolati dalle seguenti fonti: Bloomberg/Reuters e sito internet della società emittente il titolo sottostante il Certificate. Le performance passate non sono indicative, né costituiscono una garanzia, delle performance future.

### Messaggio pubblicitario con finalità promozionali.

Prima di adottare una decisione di investimento al fine di comprendere appieno i potenziali rischi e benefici connessi alla decisione di investire nei Certificate, leggere attentamente il Base Prospectus for the issuance of Certificates approvato dall'Autorité des Marchés Financiers (AMF) in data 01/06/2022, come aggiornato da successivi supplementi, le Condizioni Definitive (Final Terms) relative ai Certificate e la Nota di Sintesi e, in particolare, le sezioni dedicate ai fattori di rischio connessi all'Emittente e al Garante, all'investimento, ai costi e al trattamento fiscale, il relativo documento contenente le informazioni chiave (KID), ove disponibile, nonché la scheda prodotto del collocatore. La documentazione di offerta e il KID, ove disponibile, sono consultabili sul sito web [investimenti.bnpparibas.it](http://investimenti.bnpparibas.it). L'approvazione del Base Prospectus non dovrebbe essere intesa come approvazione dei Certificate. Il presente documento è redatto a fini promozionali e le informazioni in esso contenute non costituiscono una ricerca, una consulenza o un'offerta al pubblico dei Certificate. Il presente documento non fa parte della documentazione di offerta, né può sostituire la stessa ai fini di una corretta decisione di investimento. Gli importi, espressi in percentuale o in euro, e gli scenari sono meramente indicativi e hanno un fine esclusivamente esemplificativo e non esaustivo. L'investimento nei Certificate comporta, tra gli altri, a scadenza il rischio di perdita totale o parziale del capitale investito durante il periodo di sottoscrizione, nonché il rischio Emittente e il rischio di assoggettamento del Garante agli strumenti di gestione delle crisi bancarie (bail-in). Ove i Certificate siano venduti prima della scadenza, l'investitore potrebbe incorrere in perdite in conto capitale. Le informazioni e i grafici a contenuto finanziario qui riportati sono meramente indicativi e hanno scopo esclusivamente esemplificativo e non esaustivo. Informazioni aggiornate sulla quotazione dei Certificate sono disponibili sul sito web [investimenti.bnpparibas.it](http://investimenti.bnpparibas.it).



**BNP PARIBAS**

La banca per un mondo che cambia



**BNL**  
GRUPPO BNP PARIBAS