

DASHBOARD AU 31.07.2024

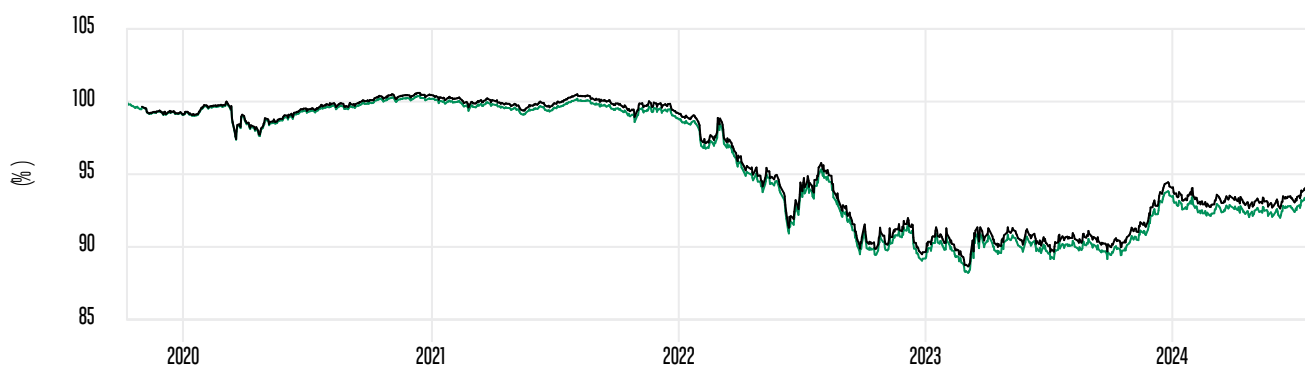


| Classe d'actifs | Indice de référence officiel | Nb de positions de l'indice de référence | Actif du compartiment (EUR mn.) |
|-------------------|--|--|---------------------------------|
| Produits de taux | JPM ESG EMU Govt Bond IG 3-5Y (EUR) RI | 67 | 2286 |
| Devise de gestion | Indice de comparaison | Article SFDR | MSCI ESG Fund Rating |
| EUR | JPM EMU 3-5 Years (EUR) RI | 8 | A |

DESCRIPTION DE L'INDICE DE RÉFÉRENCE :

L'indice de référence est l'indice J.P. Morgan ESG EMU Government Bond IG 3- 5 Year (TR) publié par JP Morgan. La composition de l'indice est revue tous les mois. L'indice est évalué quotidiennement. L'indice vise à suivre la performance de la dette publique intérieure éligible à taux fixe et libellée en euros émise par les pays de la zone euro avec un encours de dette d'au moins 80 milliards d'euros. Les titres doivent être notés «investment grade» et arriver à échéance dans les 3 à 5 prochaines années pour être éligibles. L'indice applique une méthodologie de notation et de filtrage environnementale, sociale et de gouvernance (ESG) pour privilégier les émetteurs mieux classés sur les critères ESG et sous-pondérer ou supprimer les émetteurs qui se classent plus bas. De plus amples informations sur l'indice, sa composition, son calcul et les règles de contrôle et de rebalancement périodique, ainsi que sur la méthodologie générale commune à tous les indices J.P. Morgan ESG, figurent sur le site Internet www.jpmorgan.com L'indice de comparaison est JPM EMU 3-5 Years (EUR) RI

PERFORMANCES (CUMULÉES SUR UNE PÉRIODE DE 5 ANS EN EUR)



Performances cumulées au 31.07.2024 (en %)

| | YTD | 1 mois | 3 mois | 6 mois | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans |
|-------------------------|------|--------|--------|--------|------|-------|-------|-------|-------|
| ● FONDS | 0,45 | 1,45 | 1,98 | 0,61 | 4,19 | -1,16 | -6,08 | -5,70 | - |
| ● INDICE DE RÉFÉRENCE | 0,52 | 1,46 | 2,02 | 0,68 | 4,34 | -0,89 | -5,70 | -5,16 | - |
| ● INDICE DE COMPARAISON | 0,55 | 1,49 | 2,03 | 0,71 | 4,39 | -0,81 | -5,63 | -5,08 | - |



Performances calendaires au 31.07.2024 (en %)

| | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 | 2015 | 2014 |
|-------------------------|------|-------|-------|------|------|------|------|------|------|------|
| ● FONDS | 4,90 | -9,79 | -1,33 | 1,11 | - | - | - | - | - | - |
| ● INDICE DE RÉFÉRENCE | 5,07 | -9,69 | -1,22 | 1,34 | - | - | - | - | - | - |
| ● INDICE DE COMPARAISON | 5,10 | -9,68 | -1,21 | 1,35 | - | - | - | - | - | - |

(1) Tous les chiffres sont nets de frais (en EUR). Les performances ou réalisations du passé ne sont pas indicatives des performances futures.

12/2020 : Au cours de cette période, l'indice de référence était le Bloomberg Barclays Euro Aggregate Treasury 3-5 yr (TR).

Source : BNP Paribas Asset Management

Toutes les données et performances s'appliquent à cette date, sauf indication contraire.

Pour de plus amples informations, en particulier sur les risques du produit, veuillez consulter le prospectus et le DICI du fonds.



POSITIONS DE L'INDICE DE RÉFÉRENCE : (en %)

| par Devise (%) | | | par Pays (%) | | |
|----------------|---------------|------------------------------------|----------------------|---------------|------------------------------------|
| | | Par rapport à l'indice Comparaison | | | Par rapport à l'indice Comparaison |
| EUR | 100,00 | - 0,00 | France | 27,30 | - 0,32 |
| Total | 100,00 | | Italie | 17,49 | - 2,74 |
| | | | Allemagne | 22,17 | + 2,23 |
| | | | Espagne | 15,19 | - 0,18 |
| | | | Belgique | 4,54 | - 0,05 |
| | | | Pays-Bas | 4,45 | + 0,45 |
| | | | Autriche | 3,19 | + 0,32 |
| | | | Portugal | 2,45 | - 0,03 |
| | | | Finlande | 1,88 | + 0,19 |
| | | | République d'Irlande | 1,34 | + 0,13 |
| | | | Liquidités | - | - 0,00 |
| | | | Autres | - | - 0,00 |
| | | | Total | 100,00 | |

| par Rating (%) | | | par Maturité | | |
|----------------|---------------|------------------------------------|--------------|---------------|------------------------------------|
| | | Par rapport à l'indice Comparaison | | | Par rapport à l'indice Comparaison |
| AAA | 26,62 | + 2,68 | 1 - 3 ans | - | - 0,00 |
| AA+ | 5,06 | + 0,51 | 3 - 5 ans | 98,63 | + 0,21 |
| AA | 1,34 | + 0,13 | 5 - 7 ans | 1,37 | - 0,21 |
| AA- | 31,84 | - 0,38 | Liquidités | - | - 0,00 |
| A- | 17,64 | - 0,21 | Total | 100,00 | |
| BBB | 17,49 | - 2,74 | | | |
| Autres | - | - 0,00 | | | |
| Liquidités | - | - 0,00 | | | |
| Total | 100,00 | | | | |

Source : BNP Paribas Asset Management, en date du 31.07.2024.

Les titres ci-dessus sont mentionnés à titre d'information uniquement et ne doivent pas être considérés comme une recommandation d'investissement. Les données présentées dans les factsheets sont basées sur les données comptables officielles et sont basées sur la date de transaction.



Score ESG global
58,29

BNPPAM INFORMATIONS EXTRA-FINANCIÈRES

CONTRIBUTION ESG

| | Contrib. environnementale (E) | Contrib. sociale (S) | Contrib. gouvernance (G) |
|--------------|-------------------------------|----------------------|--------------------------|
| Portefeuille | 3,83 | 3,60 | 0,86 |

COUVERTURE DU PORTEFEUILLE

| | Couverture |
|----------------|------------|
| Couverture ESG | 100,00 % |

Caractéristiques de durabilité MSCI (TELLES QUE DISPONIBLES SUR LE SITE MSCI À LA FIN DE MOIS PRÉCÉDENT)

| | | | |
|--|------|---|----|
| MSCI ESG Fund Rating | A | | |
| MSCI Weighted Average Carbon Intensity (tonnes de CO2e/\$M CA) | - | Couverture MSCI Weighted Average Carbon Intensity | 0% |
| MSCI ESG Quality Score (0-10) | 6,48 | | |

Score ESG global

La méthodologie interne de BNPP AM détermine le score ESG des émetteurs en évaluant leur performance par rapport aux entreprises du même groupe de pairs sur la base d'un nombre limité de critères ESG relatifs à l'environnement (ex: changement climatique), aux problématiques sociales (ex: gestion des ressources humaines), et à la gouvernance d'entreprise (ex: indépendance et compétence des dirigeants). L'univers d'investissement est scindé par géographie et par secteur, ce qui permet de composer des groupes d'entreprises comparables, dit « groupe de pairs ». BNPP AM utilise de nombreuses sources de recherche et de données (notamment Sustainalytics, ISS et Trucost) pour calculer les scores ESG des entreprises. Si les engagements et les pratiques de l'émetteur sur un des critères d'évaluation (E, S ou G) sont meilleurs que ceux de ses concurrents, il se voit attribuer une contribution positive sur ce critère. Un score de 1 à 99 est assigné à chaque émetteur, qui correspond à une base neutre de 50 à laquelle s'ajoute la somme des contributions sur chacun des trois critères d'évaluation. (par ex : 50 +2 (E) -1 (S) +3 (G) = 54 ESG global score).

Contribution ESG

Les contributions ESG sont déterminées par les analystes ESG de BNPP AM sur la base de critères détaillés permettant d'évaluer de façon systématique les engagements et les pratiques des entreprises en matière d'environnement, de social et de gouvernance. Chacune des contributions mentionnées pour le portefeuille ou l'indice de référence dans son ensemble est la moyenne pondérée des contributions des entreprises détenues en portefeuille ou entrant dans la composition de l'indice de Référence.

- La contribution environnementale (E) regroupe entre autres le rapport au changement climatique, la gestion du risque environnemental et l'utilisation des ressources naturelles.
- La contribution sociale (S) prend en compte entre autres la gestion des ressources humaines, la qualité du dialogue social et le respect de la diversité.
- La contribution de gouvernance (G) s'appuie entre autres sur la transparence sur la rémunération des dirigeants, la lutte contre la corruption et l'égalité homme femme.

Couverture du portefeuille

The coverage represents, within an Index replicated by the fund, the percentage of securities that have an ESG score or carbon footprint using BNPP AM's internal methodology which can be lower than the full coverage offered per the index provider

MSCI ESG Fund Rating

La notation ESG de MSCI est calculée comme une cartographie directe des scores de qualité ESG aux catégories de notation par lettre (par exemple AAA = 8,6-10). Les notations ESG vont du leader (AAAAA), de la moyenne (A, BBB, BB) à la traîne (B, CCC).

MSCI Weighted Average Carbon Intensity

Il mesure l'exposition d'un fonds à des entreprises carbo-intensives. Ce chiffre représente l'estimation des émissions de gaz à effet de serre par tranche de 1 million de \$ de chiffre d'affaires sur l'ensemble des positions du fonds. Cela permet des comparaisons entre fonds de différentes tailles.

Couverture MSCI Weighted Average Carbon Intensity

C'est le pourcentage des positions du fonds pour lequel les données de MSCI Carbon Intensité sont disponibles. La mesure d'intensité carbone moyenne pondérée de MSCI est affichée pour les fonds couverts. Les fonds à faible couverture peuvent ne pas représenter pleinement les caractéristiques carbone du fonds en raison du manque de couverture.

MSCI ESG Quality Score (0-10)

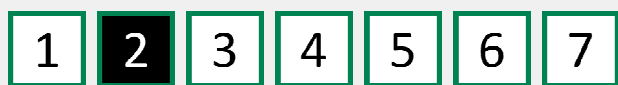
Le score de qualité ESG MSCI (0-10) pour les fonds est calculé à l'aide de la moyenne pondérée des notes ESG des positions des fonds. Le Score prend également en compte l'évolution des notations ESG des positions et l'exposition du fonds aux positions de la catégorie "laggard". MSCI évalue les positions sous-jacentes en fonction de leur exposition aux risques ESG spécifiques au secteur et de leur capacité à gérer ces risques par rapport à leurs pairs.

Pour plus d'info sur les indicateurs ESG ou sur les méthodologies de calcul des taux de couvertures veuillez-vous référer à notre page web dédiée: <https://www.bnpparibas-am.com/fr/dispositif-de-notation-esg/> & <https://www.bnpparibas-am.com/fr/mesure-de-lempreinte-carbone/>
Pour plus d'informations sur nos documents de développement durable, veuillez consulter la page web de BNPP AM : <https://www.bnpparibas-am.com/fr/documentation-sustainability/>



RISQUE

Niveau de risque et de rendement



Risque plus faible

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit 3 années. Vous risquez de ne pas pouvoir vendre facilement votre Produit, ou de devoir le vendre à un prix qui influera sensiblement sur le montant que vous percevrez en retour.

Risque plus élevé

Analyse de risque (1 an, hebdomadaire)

Fonds

| | |
|---|------|
| Volatilité | 2,92 |
| Tracking Error | 0,03 |
| Tracking Error Indice officiel de référence / comparaison | 0,04 |
| Sensibilité (31.07.2024) | 3,68 |
| YTM (rendement actuariel) (31.07.2024) | 2,61 |
| Coupon moyen | 2,10 |
| Duration | 3,68 |

L'indicateur synthétique de risque permet d'apprécier le niveau de risque de ce Produit par rapport à d'autres. Il indique la probabilité que ce Produit enregistre des pertes en cas de mouvements sur les marchés ou d'une impossibilité de notre part de vous payer.

Nous avons classé ce Produit dans la classe de risque 2 sur 7, qui est une classe de risque basse.

La catégorie de risque se justifie par l'investissement effectué principalement dans des instruments de Taux d'intérêt. L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait qu'une hausse des taux d'intérêt a pour conséquence une diminution de la valeur des investissements en obligations et titres de créance et, plus généralement, des instruments à revenu fixe.

Attention au risque de change. Si la devise de votre compte est différente de celle de ce Produit, les sommes qui vous seront versées dépendront du taux de change entre les deux devises. Ce risque n'est pas pris en compte dans l'indicateur ci-dessus.

Autres risques matériellement pertinents pour le Produit mais non repris dans l'indicateur synthétique de risque :

- **Risque de crédit:** le risque que la solvabilité d'un émetteur se détériore ou qu'il fasse défaut, entraînant potentiellement une baisse de la valeur des instruments associés.
- **Risque opérationnel:** en cas de défaillance opérationnelle au sein de la société de gestion, de l'un de ses agents ou du dépositaire, les investisseurs pourraient subir diverses perturbations (retard de paiement, de livraison...).

Pour plus de détails concernant les risques, veuillez vous référer au prospectus.

Ce Produit ne prévoyant pas de protection contre les aléas de marché, vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement.

DÉTAILS

Commissions

| | |
|---------------------------------|-------|
| Frais courants réels (31.12.23) | 0,15% |
| Commission de gestion max. | 0,03% |

Données de l'indice au 31.07.2024

| | |
|-----|--|
| Nom | JPM ESG EMU Govt Bond IG 3-5Y (EUR) RI |
|-----|--|

Codes

| | |
|----------------|--------------|
| Code ISIN | LU2008763182 |
| Code Bloomberg | BBBTIEA LX |

Places de quotation

| | | |
|----------------|----------------|--------------|
| Euronext Paris | Code Bloomberg | Code Reuters |
| | BBBTIEA LX | N/A |

Chiffres clés

| | |
|----------------------------------|----------|
| VL | 93,95 |
| Actif du compartiment (Euro mn.) | 2 285,70 |

Caractéristiques

| | |
|------------------------------------|--|
| Forme juridique | Compartiment de SICAV BNP PARIBAS EASY de droit Luxembourgeois |
| Durée d'investissement recommandée | 3 |
| Éligible au PEA | Non |
| Indice de référence | JPM ESG EMU Govt Bond IG 3-5Y (EUR) RI |
| Domiciliation | Luxembourg |
| Date de première VL | 09.10.2019 |
| Gérant(s) | Sany NGO |
| Société de gestion | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg |
| Gérant délégué | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe |
| Dépositaire | BNP PARIBAS, Luxembourg Branch |



Caractéristiques

| | |
|-------------------------|---|
| Devise de base | EUR |
| Exécution/Type de cours | VL + 1 |
| Catégorie AMF | 2 - Approche non significativement engageante |
| Article SFDR | Article 8 – Promotion de caractéristiques environnementales ou sociales |



GLOSSAIRE

Tracking Error

La tracking error mesure la volatilité du rendement relatif d'un portefeuille par rapport à son indice de référence.

Volatilité

La volatilité d'un actif est l'écart-type de son rendement. En tant que mesure de la dispersion, elle évalue l'incertitude des prix des actifs, qui est souvent assimilée à leur risque. La volatilité peut être calculée ex post (rétrospectivement) ou estimée ex ante (anticipativement).

Un glossaire des termes financiers employés dans ce document est disponible à l'adresse <http://www.bnpparibas-am.com>

DISCLAIMER

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT EUROPE est une société de gestion de portefeuille agréée par l'Autorité des marchés financiers sous le n° GP96002, constituée sous forme de société par actions simplifiée, ayant son siège social au 1, boulevard Haussmann 75009 Paris, France, RCS Paris 319 378 832, et son site web : www.bnpparibas-am.com.

Le présent document a été rédigé et est publié par la société de gestion de portefeuille.

Ce contenu vous est communiqué à titre purement informatif et ne constitue :

1. ni une offre de vente, ni une sollicitation d'achat, et ne doit en aucun cas servir de base ou être pris en compte pour quelque contrat ou engagement que ce soit ;
2. ni un conseil d'investissement.

Le présent document se réfère à un ou plusieurs instruments financiers agréés et réglementés dans leur juridiction de constitution.

Aucune action n'a été entreprise qui permettrait l'offre publique de souscription des instruments financiers dans toute autre juridiction, excepté suivant les indications de la version la plus récente du prospectus des instruments financiers ou sur le site web (rubrique « nos fonds »), dans laquelle une telle action serait requise, en particulier, aux États-Unis, pour les ressortissants américains (ce terme est défini par le règlement S du United States Securities Act de 1933). Avant de souscrire dans un pays dans lequel les instruments financiers sont enregistrés, les investisseurs devraient vérifier les contraintes ou restrictions légales potentielles relatives à la souscription, l'achat, la possession ou la vente des instruments financiers en question. Il est conseillé aux investisseurs qui envisagent de souscrire des instruments financiers de lire attentivement la version la plus récente du prospectus et du document d'information clé (DIC) et de consulter les rapports financiers les plus récents des instruments financiers en question lorsque ceux-ci sont déjà disponibles.

Ces documents sont disponibles dans la langue du pays dans lequel l'organisme de placement collectif/instrument financier est autorisé à la commercialisation et /ou en anglais le cas échéant, sur le site suivant, rubrique « nos fonds » : www.bnpparibas-am.com.

Les opinions exprimées dans le présent document constituent le jugement de la société de gestion de portefeuille à la date de publication du document et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. La société de gestion de portefeuille n'a pas l'obligation de les tenir à jour ni de les modifier. Il est recommandé aux investisseurs de consulter leurs propres conseillers juridiques et fiscaux en fonction des considérations légales, fiscales, domiciliaires et comptables qui leur sont applicables avant d'investir dans les instruments financiers afin de déterminer eux-mêmes l'adéquation et les conséquences de leur investissement, pour autant que ceux-ci soient autorisés. À noter que différents types d'investissements, mentionnés le cas échéant dans le présent document, impliquent des degrés de risque variables et qu'aucune garantie ne peut être donnée quant à l'adéquation, la pertinence ou la rentabilité d'un investissement spécifique pour le portefeuille d'un client ou futur client.

Compte tenu des risques économiques et de marché, aucune garantie ne peut être donnée quant à la réalisation par les instruments financiers de leurs objectifs d'investissement. Les performances peuvent varier notamment en fonction des objectifs ou des stratégies d'investissement des instruments financiers et des conditions économiques et de marché importantes, notamment les taux d'intérêt. Les différentes stratégies appliquées aux instruments financiers peuvent avoir un impact significatif sur les résultats présentés dans ce document. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et la valeur des investissements dans les instruments financiers est susceptible par nature de varier à la hausse comme à la baisse. Il se peut que les investisseurs ne récupèrent pas leur investissement initial.

Les données de performance, éventuellement présentées dans ce document, ne prennent en compte ni les commissions et frais contractés à l'émission ou au rachat de parts ni les taxes.

Vous pouvez obtenir, en cliquant ici : www.bnpparibas-am.fr/investisseur-professionnel/synthese-des-droits-des-investisseurs /un résumé des droits des investisseurs en français. BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT EUROPE peut décider de cesser la commercialisation des instruments financiers, dans les hypothèses visées par la réglementation applicable.

« L'investisseur durable d'un monde qui change » reflète l'objectif de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT EUROPE d'inscrire le développement durable dans le cadre de ses activités, sans pour autant que tous les produits gérés par BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT EUROPE ne relèvent de l'article 8, ayant une proportion minimale d'investissements durables, ou de l'article 9 du Règlement Européen 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR). Vous trouverez plus d'information sous le lien www.bnpparibas-am.com/en/sustainability

Disclaimer Morningstar:

Droits d'auteur © 2023 Morningstar, Inc. www.morningstar.com Tous droits réservés. La notation globale de chaque fonds, indiquée par une ou plusieurs étoiles, s'appuie sur une moyenne pondérée du nombre d'étoiles attribuées à chaque fonds au cours des périodes de notation de trois, cinq et dix ans. Les informations contenues dans le présent document : (1) sont la propriété de Morningstar et/ou de ses fournisseurs de contenu; (2) ne peuvent être copiées ou distribuées et (3) leur exactitude, leur exhaustivité et leur caractère opportun ne sont pas garantis. Ni Morningstar ni ses fournisseurs de contenu ne peuvent être tenus responsables de tout dommage ou perte découlant de l'utilisation de ces informations. Les performances du passé ne présument en rien des performances futures.

Index disclaimer

Bien que les informations et les indices proviennent de sources jugées fiables, J.P. Morgan ne peut pas garantir leur exactitude ni leur exhaustivité. Les informations et les indices sont utilisés avec autorisation. Sauf autorisation écrite expresse de J.P. Morgan, la reproduction, l'utilisation et la distribution des informations et des indices sont strictement interdites. Copyright 2019, JPMorgan Chase & Co. Tous droits réservés. «Morgan-» et les indices sont



des marques commerciales de JPMorgan Chase & Co., dont une licence a été concédée à BNP Paribas Asset Management à des fins particulières. Le(s) Produit(s) de BNP Paribas Asset Management dérivé(s) des indices ne sont pas sponsorisés, cautionnés, commercialisés ni promus par J.P. Morgan et J.P. Morgan n'émet aucune opinion concernant l'opportunité d'investir dans un(de) tel(s) Produit(s).

