

DASHBOARD AU 31.08.2020

Classe d'actifs	Indice de référence	Nb de positions du benchmark	Actif du compartiment (EUR mn.)
Actions	MSCI EUROPE SMALL CAPS SRI S-Series 5% Capped (NTR)	200	35
Niveau de risque et de rendement	Performance YTD (1)	Perf. annualisée sur 3 ans (2)	
<div style="display: flex; justify-content: space-between; width: 100px;"> 1234567 </div>	-10,30 % Indice de référence -10,37 %	2,15 % Indice de référence 2,03 %	

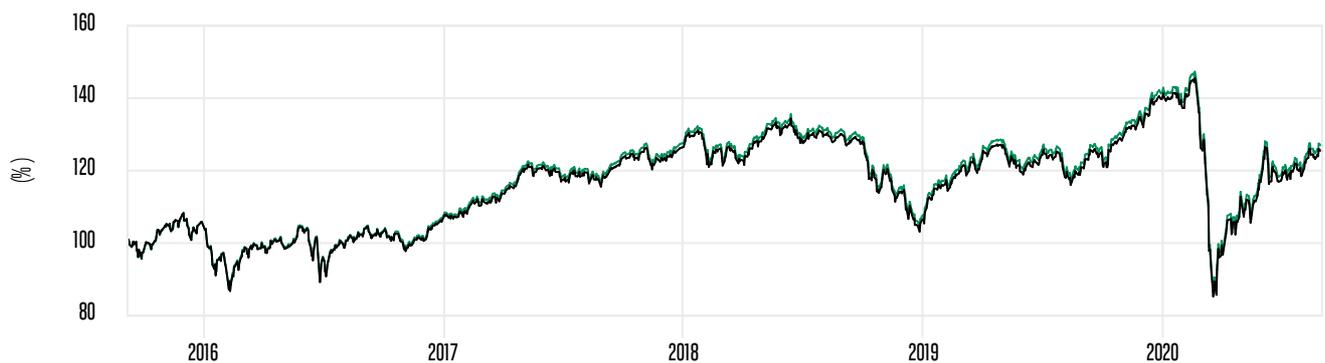
(1) Tous les chiffres sont nets de frais (en EUR).

(2) Basée sur 360 jours

DESCRIPTION DE L'INDICE :

L'indicateur de référence est l'indice MSCI Europe Small Cap SRI S Series 5 % Capped (NTR) publié en USD par MSCI. L'indice est construit en deux étapes. La méthodologie cible les titres de sociétés ayant les notations ESG les plus élevées de l'indice parent. Ensuite, les sociétés impliquées dans les activités suivantes sont exclues de l'univers de sélection : alcool, jeux d'argent, tabac, armes militaires, armes à feu civiles, énergie nucléaire, divertissements pour adultes, pétrole & gaz conventionnels et non conventionnels, et enfin charbon. L'indice est conçu pour avoir une représentation sectorielle et régionale similaire à celle de l'indice MSCI Europe Small Cap. Le poids maximal d'une société est de 5 % à chaque rééquilibrage.

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



Performances cumulées au 31.08.2020 (en %)

	YTD	1 mois	3 mois	6 mois	1 an	2 ans	3 ans	4 ans	5 ans
● FONDS	-10,30	5,56	7,26	-0,74	3,79	-3,25	6,70	24,24	26,36
● INDICE DE RÉFÉRENCE	-10,37	5,58	7,29	-0,77	3,70	-3,46	6,31	23,07	24,96

Performances calendaires au 31.08.2020 (en %)

	2019	2018	2017	2016	2015
● FONDS	31,56	-15,62	19,17	1,01	23,94
● INDICE DE RÉFÉRENCE	31,44	-15,75	18,77	0,54	24,73

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

09/2012-02/2016 : À la suite d'une opération sur titres le 19/02/2016, les performances indiquées correspondent à celles du compartiment « PARWORLD TRACK EUROPE SMALL CAP ». Le compartiment « BNP PARIBAS EASY MSCI EUROPE SMALL CAPS EX CW » est géré conformément à une stratégie d'investissement, des processus et des frais absolument identiques.

10/2015-04/2020 : Au cours de cette période, l'indice de référence était le « MSCI Europe Small Caps ex Controversial Weapons NTR » et la dénomination du Fonds était « MSCI EUROPE SMALL CAPS EX CW »

POSITIONS BENCHMARK: (en %)

Principales positions		par Pays (benchmark)	
RIGHTMOVE PLC	2,23	Royaume-Uni	36,97
EURONEXT NV	2,05	Suède	16,73
KESKO CLASS B B	1,73	France	6,71
PENNON GROUP PLC	1,70	Suisse	6,46
HOMESERVE PLC	1,57	Allemagne	5,10
SIMCORP	1,55	Autriche	2,82
CASTELLUM	1,43	Belgique	1,90
AMS AG	1,39	Pays-Bas	0,90
METSO OUTOTEC CORP	1,39	Afrique du Sud	0,41
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	1,35	Autres	22,01
Nb de positions dans le benchmark	200	Total	100,00

par Secteur (benchmark) (%)

Industrie	24,16
Finance	13,55
Consommation discrétionnaire	10,31
Immobilier	10,04
Technologie de l'information	9,34
Services de communication	6,53
Consommation de base	5,75
Matières premières	5,58
Services publics	3,28
Energie	2,18
Autres	9,27
Total	100,00

Source : BNP Paribas Asset Management, en date du 31.08.2020

Les titres ci-dessus sont mentionnés à titre d'information uniquement et ne doivent pas être considérés comme une recommandation d'investissement.



RISQUE

Niveau de risque et de rendement

La note de risque et de rendement pour ce fonds est:

Risque faible=Rendement
potentiellement plus faible1 : risque le moins élevé; 7 : risque le plus élevé. SRRI : indicateur synthétique de
risque et de rendement. Plus le risque est élevé, plus l'horizon d'investissement
recommandé est long.Risque élevé=Rendement
potentiellement plus élevé

Analyse de risque (sur 3 ans, mensuelle)

Fonds

Volatilité	19,31
Tracking Error	0,06

Les investissements réalisés dans des compartiments sont soumis aux fluctuations du marché et aux risques inhérents aux investissements en valeurs mobilières. La valeur des investissements et les revenus qu'ils génèrent peuvent enregistrer des hausses comme des baisses et il se peut que les investisseurs ne récupèrent pas leur investissement initial. Le fonds décrit ci-dessus comprend un risque de perte en capital.

Pourquoi le fonds relève-t-il de cette catégorie précise ?

La catégorie de risque se justifie par l'investissement effectué principalement dans des Actions, dont la valeur peut varier considérablement. Ces fluctuations sont souvent amplifiées à court terme.

D'autres risques importants pour le fonds, mais qui ne sont pas adéquatement pris en considération par l'indicateur, sont exposés ci-dessous :

- **Risque de contrepartie:** lié à la capacité de la contrepartie sur les marchés de gré à gré à respecter ses engagements tels que le paiement, la livraison ou le remboursement.
- **Risque de crédit:** risque de dégradation de la signature d'un émetteur ou sa défaillance pouvant entraîner une baisse de la valeur des instruments financiers qui lui sont associés.
- **Risque Lié aux instruments dérivés:** en investissant dans des instruments dérivés négociés de gré à gré ou cotés, le Fonds vise à couvrir et/ou donner un effet de levier au rendement de sa position. L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait que l'effet de levier augmente la volatilité du compartiment.
- **Risque de liquidité:** Ce risque résulte de la difficulté de vendre un titre à sa juste valeur et dans un laps de temps raisonnable du fait d'un manque d'acheteurs.

Pour une description et une définition complètes des risques, veuillez consulter le prospectus et le DICI les plus récents des fonds.

DÉTAILS

Commissions

Frais d'entrée max.	3,00%
Frais de sortie max.	0,00%
Commission de conversion max.	1,50%
Frais courants réels (31.10.19)	0,25%
Commission de gestion max.	0,08%

Données de l'indice au 31.08.2020

Nom	MSCI EUROPE SMALL CAPS SRI S-Series 5% Capped (NTR)
Code Bloomberg	MXEUSNE
Code Reuters	.MIEUF00msNEU

Codes

Code ISIN	LU1291101126
-----------	--------------

Places de quotation

Code Bloomberg

Code Reuters

Euronext Paris	BNMSCTP LX	LU1291101126.LUF
----------------	------------	------------------

Chiffres clés

VL	223,79
Actif du compartiment (Euro mn.)	35,11

Caractéristiques

Forme juridique	Compartiment de SICAV BNP PARIBAS EASY de droit Luxembourgeois
Durée d'investissement recommandée	5 ans
Éligible au PEA	Oui
Éligible à une assurance-vie	Non
Indice de référence	MSCI EUROPE SMALL CAPS SRI S-Series 5% Capped (NTR)
Domiciliation	Luxembourg
Date de lancement	19.02.2016
Gérant	Alexandre ZAMORA
Société de gestion	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg
Dépositaire	BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES-LUXEMBOURG BRANCH
Devise de base	EUR
Devises disponibles	USD
Exécution/Type de cours	VL + 1



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 France 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. Il contient des opinions et des données statistiques considérées légitimes et correctes le jour de leur publication conformément à l'environnement économique et financier en place à cette date. Le présent document ne constitue ni un conseil d'investissement, ni une invitation, ni une offre de souscription, ni une sollicitation d'achat de quelconque instrument financier et ne doit en aucun cas servir de base, en tout ou en partie, pour quelconque contrat ou engagement que ce soit.

Ces informations sont communiquées sans connaissance de la situation spécifique de l'investisseur. Avant toute souscription, les investisseurs devraient vérifier dans quels pays le ou les instruments financiers visés dans le présent document sont enregistrés et autorisés à la vente au public. En particulier, les instruments financiers ne peuvent être offerts ou vendus publiquement aux États-Unis. Il est conseillé aux investisseurs qui envisagent de souscrire de lire attentivement la version la plus récente du prospectus et du document d'information clé pour l'investisseur (DICI) approuvés par l'autorité compétente, disponible auprès du site web. Les investisseurs sont également invités à consulter les rapports financiers les plus récents, également disponibles sur le site web. Il est recommandé aux investisseurs de consulter leurs propres conseillers juridiques et fiscaux avant d'investir dans les instruments financiers. 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. Leur valeur est susceptible par nature de varier de la hausse comme à la baisse. En particulier, la valeur d'un investissement peut varier en fonction des fluctuations des taux de change. Les chiffres de performance sont communiqués après déduction des commissions de gestion et sont calculés sur la base de rendements globaux. Ils s'entendent facteur temporel, dividendes nets et intérêts réinvestis compris, mais n'incluent ni les taxes ou frais de souscription ou de rachat, ni les commissions ou taxes de change. Les performances passées ne constituent en rien une garantie pour les performances à venir.

La documentation visée par le présent avertissement est disponible sur www.bnpparibas-am.com

Disclaimer Morningstar:

Droits d'auteur © 2020 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

Ce fonds n'est pas parrainé, validé, vendu ou promu par MSCI inc. ("MSCI"), ses sociétés liées, ses fournisseurs de données ou tout autre tiers impliqué dans la collecte, le calcul ou la création de tout indice MSCI (designés collectivement, les "parties MSCI"). Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les noms des indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés liées et ont été autorisés à être utilisés à certaines fins par BNP Paribas Asset Management. Aucune des parties MSCI n'émet quelconque affirmation ou garantie, explicite ou implicite, à l'émetteur ou aux propriétaires de ce fonds ou à toute autre personne ou entité concernant la pertinence d'investir dans des fonds en général ou dans ce fonds en particulier ou concernant la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance des marchés d'actions. MSCI ou ses sociétés liées sont les donneurs de licence de certaines marques commerciales et marques de service des indices MSCI qui sont déterminés, composés et calculés par MSCI sans rapport avec ce fonds ou l'émetteur ou les propriétaires de ce fonds ou toute autre personne ou entité. Aucune des parties MSCI n'a l'obligation de tenir compte des besoins de l'émetteur ou des propriétaires de ce fonds ou de toute autre personne ou entité pour déterminer, composer ou calculer les indices MSCI. Aucune des parties MSCI ne peut être tenue pour responsable de ni ne participe à la détermination du timing, des prix ou des quantités de ce fonds à émettre ou à la détermination ou au calcul de l'équation ou des conditions selon lesquelles ce fonds est remboursable.

