

OBJECTIF

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

PRODUIT

BNP PARIBAS INDICE EURO, Part Classic de classe C (FR0011538230)

Initiateur : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe (« BNPP AM »)

Site Internet : <https://www.bnpparibas-am.com>

Numéro de téléphone : appelez le +33.1.58.97.13.09 pour de plus amples informations.

L'Autorité des marchés financiers (« AMF ») est chargée du contrôle de BNPP AM en ce qui concerne ce document d'informations clés.

BNPP AM est agréée en France sous le n°GP96002 et réglementée par l'AMF.

Date de production du document d'informations clés : 01/03/2024

EN QUOI CONSISTE CE PRODUIT ?

Type

Ce Produit est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) nourricier. Il est constitué sous forme de fonds commun de placement (FCP) soumis aux dispositions du code monétaire et financier et à la directive OPCVM 2009/65/CE modifiée.

Un fonds nourricier est un fonds investi au minimum à 85% dans un seul autre OPC qui prend alors la qualification de fonds maître.

Durée

Ce Produit a été initialement créé pour une durée de 99 ans.

BNPP AM a le droit de procéder à la dissolution du Produit de manière unilatérale. La dissolution peut également intervenir en cas de fusion, de rachat total des parts ou lorsque l'actif net du Produit est inférieur au montant minimum réglementaire et, de dissolution du fonds maître.

Objectifs

Objectif de gestion : BNP PARIBAS INDICE EURO a pour classification Actions des pays de zone euro et est nourricier de la catégorie d'action EUR C/D du compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR, qui a pour objectif de gestion *de répliquer la performance de l'indice EURO STOXX® 50 Net Return, quelle que soit son évolution à la hausse comme à la baisse, avant prélèvement des frais de gestion et de fonctionnement. Le Compartiment étant indiciel, il a pour objectif de maintenir l'écart de suivi en valeur absolue entre l'évolution de la valeur liquidative du Compartiment et celle de l'indice à un niveau inférieur à 1%. Si cet écart de suivi dépasse 1%, il ne devra en tout état de cause pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.* La performance du Produit peut être inférieure à celle du compartiment maître en raison des frais de gestion propres au Produit.

Caractéristiques essentielles du Produit : Il est investi en totalité dans le compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF (compartiment maître) de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR et, à titre accessoire, en liquidités. L'indicateur de référence du compartiment maître et du Produit est l'indice EURO STOXX® 50 Net Return (code Bloomberg : SX5T Index), calculé dividendes nets réinvestis.

Le compartiment maître est dit à gestion indicelle et a pour objectif de respecter un écart de suivi maximum de 1%. Si l'écart de suivi devenait cependant supérieur à 1%, il ne devra pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.

L'actif du compartiment maître est composé de *titres de sociétés de tous secteurs, de grande et éventuellement moyenne capitalisation, émis sur les marchés d'un ou de plusieurs pays européens et dont la performance est destinée à être échangée contre une indexation à l'indicateur de référence.* Pour la gestion de sa trésorerie et/ou en fonction des conditions de marché, le compartiment maître *peut investir jusqu'à 15 % de son actif net en instruments du marché monétaire (bons du Trésor Français, titres de créances à court terme) ou en titres de créance négociables.*

Le compartiment maître est éligible au plan d'épargne en actions (PEA) et, en conséquence, maintient dans ses actifs au moins 75% de titres éligibles au PEA.

Le Produit est éligible au PEA.

Le Produit aura recours à des instruments dérivés tels que les futures et les options sur actions et indices boursiers. L'ensemble de ces instruments sera utilisé pour ajuster le risque actions.

Les demandes de rachat sont centralisées par BNP Paribas du lundi au vendredi à 13 heures, sont exécutées sur la base de la valeur liquidative datée du même jour et réglées dans les cinq jours suivant la date de calcul de la valeur liquidative.

Autres informations : Affectation des sommes distribuables : résultat net : capitalisation et plus-values nettes réalisées : capitalisation.

Ce Produit pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant cinq ans. Pour plus de détails, se reporter au prospectus du Produit.

Investisseurs de détail visés

Ce Produit est conçu pour des investisseurs qui n'ont ni expertise financière ni connaissance spécifique pour comprendre le Produit, mais peuvent néanmoins supporter une perte totale du capital. Il est approprié pour des clients cherchant à accroître leur capital. Les investisseurs potentiels devraient avoir un horizon de placement d'au moins 5 années. Le Produit n'est pas commercialisé auprès des investisseurs américains entrant dans la définition de restricted person telle que résumée dans le prospectus du Produit.

Informations pratiques

■ Dépositaire : BNP PARIBAS

■ Le prospectus, les documents d'informations clés relatifs aux autres parts de ce Produit, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques rédigés en langue française du Produit, sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.

■ Le prospectus, les statuts, le document d'informations clés, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques, rédigés en langue française, du fonds maître sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.



QUELS SONT LES RISQUES ET QU'EST-CE QUE CELA POURRAIT ME RAPPORTER ?

Indicateur de risque



L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit 5 années.

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 5 sur 7, qui est une classe de risque entre moyenne et élevée. L'investissement, à travers son fonds maître, dans des instruments de type actions justifie la catégorie de risque. Ceux-ci sont sujets à d'importantes fluctuations de cours souvent amplifiées à court terme. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau entre moyen et élevé et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est probable que la valeur de votre investissement en soit affectée au moment où vous demanderez le remboursement de vos parts.

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 contrepartie** : ce risque est associé à la capacité d'une contrepartie à une transaction financière de gré à gré d'honorer ses engagements comme le paiement, la livraison et le remboursement.

- **Risque de liquidité** : ce risque résulte de la difficulté de vendre un titre à sa juste valeur et dans un délai raisonnable du fait d'un manque d'acheteurs.

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.

Les ordres de souscription/rachat du Produit sont exécutés chaque jour, conformément aux modalités prévues dans son prospectus. Les ordres de souscription/rachat dans le fonds maître sont centralisés chaque jour ouvré, conformément aux modalités prévues dans son prospectus.

Scénarios de performance

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du Produit lui-même, mais pas nécessairement tous les coûts dus à votre conseiller ou distributeur. Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également influencer sur les montants que vous recevrez. Ce que vous obtiendrez de ce Produit dépend des performances futures du marché. L'évolution future du marché est aléatoire et ne peut être prédite avec précision. Les scénarios défavorable, intermédiaire et favorable présentés représentent des exemples utilisant les meilleures et pires performances, ainsi que la performance moyenne du Produit et/ou de l'indice de référence approprié au cours des 10 dernières années. Les marchés pourraient évoluer très différemment à l'avenir. Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

Période de détention recommandée : 5 ans

Exemple d'investissement : 10.000 EUR

Si vous sortez après 1 an

Si vous sortez après 5 ans

Scénarios

Minimum	Il n'existe aucun rendement minimal garanti. Vous pourriez perdre tout ou une partie de votre investissement.		
Tensions	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	5.257,53 EUR	1.333,3 EUR
	Rendement annuel moyen	-47,42%	-33,17%
Défavorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	8.148,31 EUR	8.341,72 EUR
	Rendement annuel moyen	-18,52%	-3,56%
Intermédiaire	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	10.357,23 EUR	12.331,7 EUR
	Rendement annuel moyen	3,57%	4,28%
Favorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	14.367,47 EUR	16.472,76 EUR
	Rendement annuel moyen	43,67%	10,50%

Le scénario favorable s'est produit pour un investissement entre 2018 et 2023.

Le scénario intermédiaire s'est produit pour un investissement entre 2014 et 2019.

Le scénario défavorable s'est produit pour un investissement entre 2015 et 2020.

QUE SE PASSE-T-IL SI BNPP AM N'EST PAS EN MESURE D'EFFECTUER LES VERSEMENTS ?

Le Produit est une copropriété d'instruments financiers et de dépôts distincte de BNPP AM.

En cas de défaillance de BNPP AM, les actifs du Produit conservés par le dépositaire ne seront pas affectés.

En cas de défaillance du dépositaire, le risque de perte financière du Produit est atténué en raison de la ségrégation légale des actifs du dépositaire de ceux du Produit.

QUE VA ME COÛTER CET INVESTISSEMENT ?

Il se peut que la personne qui vous vend ce Produit ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement.

Coûts au fil du temps

Les tableaux présentent les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez et du temps pendant lequel vous détenez le Produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles.

Nous avons supposé :

- qu'au cours de la première année, vous récupéreriez le montant que vous avez investi (rendement annuel de 0 %). Que pour les autres périodes de détention, le Produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire.
- que 10.000 EUR sont investis.



	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Coûts totaux	268,71 EUR	638,4 EUR
Incidence des coûts annuels (*)	2,70%	1,16% chaque année
(*) Elle montre dans quelle mesure les coûts réduisent annuellement votre rendement au cours de la période de détention. Par exemple, elle montre que si vous sortez à la fin de la période de détention recommandée, il est prévu que votre rendement moyen par an soit de 5,44% avant déduction des coûts et de 4,28% après cette déduction. Il se peut que nous partagions les coûts avec la personne qui vous vend le Produit afin de couvrir les services qu'elle vous fournit. Cette personne vous informera du montant.		
Composition des coûts		
Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie	Si vous sortez après 1 an	
Coûts d'entrée	Jusqu'à 2,00% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement.	Jusqu'à 200 EUR
Coûts de sortie	Nous ne facturons pas de coût de sortie pour ce Produit.	0 EUR
Coûts récurrents prélevés chaque année		
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation	0,69% de la valeur de votre investissement par an. Le montant se base sur une estimation du montant pouvant être prélevé sur votre capital.	67,62 EUR
Coûts de transaction	0,01% de la valeur de votre investissement par an. Il s'agit d'une estimation des coûts encourus lorsque nous achetons et vendons les investissements sous-jacents au Produit. Le montant réel varie en fonction de la quantité que nous achetons et vendons.	1,09 EUR
Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions		
Commissions liées aux résultats	Aucune commission liée aux résultats n'existe pour ce Produit.	0 EUR

COMBIEN DE TEMPS DOIS-JE LE CONSERVER, ET PUIS-JE RETIRER DE L'ARGENT DE FAÇON ANTICIPÉE ?

Période de détention recommandée : 5 ans.

La période de détention recommandée a été définie et se base sur le profil de risque et de rémunération du Produit.

Les investisseurs peuvent demander le rachat de leurs parts sur la base de la valeur liquidative dont les détails figurent dans le prospectus.

Tout rachat effectué avant la fin de la période de détention recommandée peut avoir un impact négatif sur le profil de performance du Produit et sur le profil de risque.

COMMENT PUIS-JE FORMULER UNE RECLAMATION ?

Pour toute réclamation, l'investisseur est invité à se rapprocher de son conseiller habituel auprès de l'établissement qui lui a conseillé le Produit. Il peut également s'adresser à BNPP AM via son site www.bnpparibas-am.fr (rubrique: « Politique de traitement des réclamations clients » en pied de page) ou adresser un courrier recommandé avec AR à BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, ou en envoyant un courriel à amfr.reclamations@bnpparibas.com.

AUTRES INFORMATIONS PERTINENTES

- Afin d'accéder aux performances et scénarios de performance passées du Produit, veuillez suivre les instructions ci-dessous : (1) Cliquez sur <https://www.bnpparibas-am.fr> (2) Dans la page d'accueil, allez dans « France » et sélectionnez la langue souhaitée ainsi que votre profil d'investisseur ; acceptez les termes et conditions du site internet. (3) Allez dans l'onglet « NOS FONDS » et « Recherche de fonds ». (4) Recherchez le Produit à l'aide du code ISIN ou du nom du Produit et cliquez sur le Produit. (5) Cliquez sur l'onglet « Performances ».
- Le diagramme sur le site internet affiche la performance du Produit en pourcentage de perte ou de gain par an au cours des 10 dernières années par rapport à son indice de référence. Il peut vous aider à évaluer comment le Produit a été géré dans le passé et à le comparer à son indice de référence.
- Lorsque ce Produit est utilisé comme support en unité de compte d'un contrat d'assurance sur la vie ou de capitalisation, les informations complémentaires sur ce contrat, telles que les coûts du contrat, qui ne sont pas compris dans les coûts indiqués dans le présent document, le contact en cas de réclamation et ce qui se passe en cas de défaillance de l'entreprise d'assurance sont présentées dans le document d'informations clés de ce contrat obligatoirement remis par votre assureur ou courtier ou tout autre intermédiaire d'assurance conformément à son obligation légale.
- L'investisseur peut avoir recours au Médiateur de l'AMF par courrier postal : Le Médiateur - Autorité des marchés financiers - 17, place de la Bourse - 75082 Paris CEDEX 02 ou internet : <http://www.amf-france.org> /rubrique : Le Médiateur.



OBJECTIF

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

PRODUIT

BNP PARIBAS INDICE EURO, Part Classic de classe D (FR0010536144)

Initiateur : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe (« BNPP AM »)

Site Internet : <https://www.bnpparibas-am.com>

Numéro de téléphone : appelez le +33.1.58.97.13.09 pour de plus amples informations.

L'Autorité des marchés financiers (« AMF ») est chargée du contrôle de BNPP AM en ce qui concerne ce document d'informations clés.

BNPP AM est agréée en France sous le n°GP96002 et réglementée par l'AMF.

Date de production du document d'informations clés : 01/03/2024

EN QUOI CONSISTE CE PRODUIT ?

Type

Ce Produit est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) nourricier. Il est constitué sous forme de fonds commun de placement (FCP) soumis aux dispositions du code monétaire et financier et à la directive OPCVM 2009/65/CE modifiée.

Un fonds nourricier est un fonds investi au minimum à 85% dans un seul autre OPC qui prend alors la qualification de fonds maître.

Durée

Ce Produit a été initialement créé pour une durée de 99 ans.

BNPP AM a le droit de procéder à la dissolution du Produit de manière unilatérale. La dissolution peut également intervenir en cas de fusion, de rachat total des parts ou lorsque l'actif net du Produit est inférieur au montant minimum réglementaire et, de dissolution du fonds maître.

Objectifs

Objectif de gestion : BNP PARIBAS INDICE EURO a pour classification Actions des pays de zone euro et est nourricier de la catégorie d'action EUR C/D du compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR, qui a pour objectif de gestion *de répliquer la performance de l'indice EURO STOXX® 50 Net Return, quelle que soit son évolution à la hausse comme à la baisse, avant prélèvement des frais de gestion et de fonctionnement. Le Compartiment étant indiciel, il a pour objectif de maintenir l'écart de suivi en valeur absolue entre l'évolution de la valeur liquidative du Compartiment et celle de l'indice à un niveau inférieur à 1%. Si cet écart de suivi dépasse 1%, il ne devra en tout état de cause pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.* La performance du Produit peut être inférieure à celle du compartiment maître en raison des frais de gestion propres au Produit.

Caractéristiques essentielles du Produit : Il est investi en totalité dans le compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF (compartiment maître) de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR et, à titre accessoire, en liquidités. L'indicateur de référence du compartiment maître et du Produit est l'indice EURO STOXX® 50 Net Return (code Bloomberg : SX5T Index), calculé dividendes nets réinvestis.

Le compartiment maître est dit à gestion indicelle et a pour objectif de respecter un écart de suivi maximum de 1%. Si l'écart de suivi devenait cependant supérieur à 1%, il ne devra pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.

L'actif du compartiment maître est composé de *titres de sociétés de tous secteurs, de grande et éventuellement moyenne capitalisation, émis sur les marchés d'un ou de plusieurs pays européens et dont la performance est destinée à être échangée contre une indexation à l'indicateur de référence.* Pour la gestion de sa trésorerie et/ou en fonction des conditions de marché, le compartiment maître *peut investir jusqu'à 15 % de son actif net en instruments du marché monétaire (bons du Trésor Français, titres de créances à court terme) ou en titres de créance négociables.*

Le compartiment maître est éligible au plan d'épargne en actions (PEA) et, en conséquence, maintient dans ses actifs au moins 75% de titres éligibles au PEA.

Le Produit est éligible au PEA.

Le Produit aura recours à des instruments dérivés tels que les futures et les options sur actions et indices boursiers. L'ensemble de ces instruments sera utilisé pour ajuster le risque actions.

Les demandes de rachat sont centralisées par BNP Paribas du lundi au vendredi à 13 heures, sont exécutées sur la base de la valeur liquidative datée du même jour et réglées dans les cinq jours suivant la date de calcul de la valeur liquidative.

Autres informations : Affectation des sommes distribuables : résultat net : distribution et plus-values nettes réalisées : capitalisation.

Ce Produit pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant cinq ans. Pour plus de détails, se reporter au prospectus du Produit.

Investisseurs de détail visés

Ce Produit est conçu pour des investisseurs qui n'ont ni expertise financière ni connaissance spécifique pour comprendre le Produit, mais peuvent néanmoins supporter une perte totale du capital. Il est approprié pour des clients cherchant à accroître et/ou percevoir des revenus de leur capital. Les investisseurs potentiels devraient avoir un horizon de placement d'au moins 5 années. Le Produit n'est pas commercialisé auprès des investisseurs américains entrant dans la définition de restricted person telle que résumée dans le prospectus du Produit.

Informations pratiques

■ Dépositaire : BNP PARIBAS

■ Le prospectus, les documents d'informations clés relatifs aux autres parts de ce Produit, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques rédigés en langue française du Produit, sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.

■ Le prospectus, les statuts, le document d'informations clés, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques, rédigés en langue française, du fonds maître sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.



QUELS SONT LES RISQUES ET QU'EST-CE QUE CELA POURRAIT ME RAPPORTER ?

Indicateur de risque



L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit 5 années.

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 5 sur 7, qui est une classe de risque entre moyenne et élevée. L'investissement, à travers son fonds maître, dans des instruments de type actions justifie la catégorie de risque. Ceux-ci sont sujets à d'importantes fluctuations de cours souvent amplifiées à court terme. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau entre moyen et élevé et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est probable que la valeur de votre investissement en soit affectée au moment où vous demanderez le remboursement de vos parts.

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 contrepartie : ce risque est associé à la capacité d'une contrepartie à une transaction financière de gré à gré d'honorer ses engagements comme le paiement, la livraison et le remboursement.

- Risque de liquidité : ce risque résulte de la difficulté de vendre un titre à sa juste valeur et dans un délai raisonnable du fait d'un manque d'acheteurs.

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.

Les ordres de souscription/rachat du Produit sont exécutés chaque jour, conformément aux modalités prévues dans son prospectus. Les ordres de souscription/rachat dans le fonds maître sont centralisés chaque jour ouvré, conformément aux modalités prévues dans son prospectus.

Scénarios de performance

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du Produit lui-même, mais pas nécessairement tous les coûts dus à votre conseiller ou distributeur. Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également influencer sur les montants que vous recevrez. Ce que vous obtiendrez de ce Produit dépend des performances futures du marché. L'évolution future du marché est aléatoire et ne peut être prédite avec précision. Les scénarios défavorable, intermédiaire et favorable présentés représentent des exemples utilisant les meilleures et pires performances, ainsi que la performance moyenne du Produit et/ou de l'indice de référence approprié au cours des 10 dernières années. Les marchés pourraient évoluer très différemment à l'avenir. Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

Période de détention recommandée : 5 ans

Exemple d'investissement : 10.000 EUR

Si vous sortez après 1 an

Si vous sortez après 5 ans

Scénarios

Minimum	Il n'existe aucun rendement minimal garanti. Vous pourriez perdre tout ou une partie de votre investissement.		
Tensions	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	5.257,53 EUR	1.333,3 EUR
	Rendement annuel moyen	-47,42%	-33,17%
Défavorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	8.148,31 EUR	8.341,72 EUR
	Rendement annuel moyen	-18,52%	-3,56%
Intermédiaire	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	10.357,23 EUR	12.331,7 EUR
	Rendement annuel moyen	3,57%	4,28%
Favorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	14.367,47 EUR	16.472,76 EUR
	Rendement annuel moyen	43,67%	10,50%

Le scénario favorable s'est produit pour un investissement entre 2018 et 2023.

Le scénario intermédiaire s'est produit pour un investissement entre 2014 et 2019.

Le scénario défavorable s'est produit pour un investissement entre 2015 et 2020.

QUE SE PASSE-T-IL SI BNPP AM N'EST PAS EN MESURE D'EFFECTUER LES VERSEMENTS ?

Le Produit est une copropriété d'instruments financiers et de dépôts distincte de BNPP AM.

En cas de défaillance de BNPP AM, les actifs du Produit conservés par le dépositaire ne seront pas affectés.

En cas de défaillance du dépositaire, le risque de perte financière du Produit est atténué en raison de la ségrégation légale des actifs du dépositaire de ceux du Produit.

QUE VA ME COÛTER CET INVESTISSEMENT ?

Il se peut que la personne qui vous vend ce Produit ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement.

Coûts au fil du temps

Les tableaux présentent les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez et du temps pendant lequel vous détenez le Produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles.

Nous avons supposé :

- qu'au cours de la première année, vous récupéreriez le montant que vous avez investi (rendement annuel de 0 %). Que pour les autres périodes de détention, le Produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire.
- que 10.000 EUR sont investis.



	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Coûts totaux	268,71 EUR	638,4 EUR
Incidence des coûts annuels (*)	2,70%	1,16% chaque année
(*) Elle montre dans quelle mesure les coûts réduisent annuellement votre rendement au cours de la période de détention. Par exemple, elle montre que si vous sortez à la fin de la période de détention recommandée, il est prévu que votre rendement moyen par an soit de 5,44% avant déduction des coûts et de 4,28% après cette déduction. Il se peut que nous partagions les coûts avec la personne qui vous vend le Produit afin de couvrir les services qu'elle vous fournit. Cette personne vous informera du montant.		
Composition des coûts		
Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie	Si vous sortez après 1 an	
Coûts d'entrée	Jusqu'à 2,00% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement.	Jusqu'à 200 EUR
Coûts de sortie	Nous ne facturons pas de coût de sortie pour ce Produit.	0 EUR
Coûts récurrents prélevés chaque année		
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation	0,69% de la valeur de votre investissement par an. Le montant se base sur une estimation du montant pouvant être prélevé sur votre capital.	67,62 EUR
Coûts de transaction	0,01% de la valeur de votre investissement par an. Il s'agit d'une estimation des coûts encourus lorsque nous achetons et vendons les investissements sous-jacents au Produit. Le montant réel varie en fonction de la quantité que nous achetons et vendons.	1,09 EUR
Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions		
Commissions liées aux résultats	Aucune commission liée aux résultats n'existe pour ce Produit.	0 EUR

COMBIEN DE TEMPS DOIS-JE LE CONSERVER, ET PUIS-JE RETIRER DE L'ARGENT DE FAÇON ANTICIPÉE ?

Période de détention recommandée : 5 ans.

La période de détention recommandée a été définie et se base sur le profil de risque et de rémunération du Produit.

Les investisseurs peuvent demander le rachat de leurs parts sur la base de la valeur liquidative dont les détails figurent dans le prospectus.

Tout rachat effectué avant la fin de la période de détention recommandée peut avoir un impact négatif sur le profil de performance du Produit et sur le profil de risque.

COMMENT PUIS-JE FORMULER UNE RECLAMATION ?

Pour toute réclamation, l'investisseur est invité à se rapprocher de son conseiller habituel auprès de l'établissement qui lui a conseillé le Produit. Il peut également s'adresser à BNPP AM via son site www.bnpparibas-am.fr (rubrique: « Politique de traitement des réclamations clients » en pied de page) ou adresser un courrier recommandé avec AR à BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, ou en envoyant un courriel à amfr.reclamations@bnpparibas.com.

AUTRES INFORMATIONS PERTINENTES

- Afin d'accéder aux performances et scénarios de performance passées du Produit, veuillez suivre les instructions ci-dessous : (1) Cliquez sur <https://www.bnpparibas-am.fr> (2) Dans la page d'accueil, allez dans « France » et sélectionnez la langue souhaitée ainsi que votre profil d'investisseur ; acceptez les termes et conditions du site internet. (3) Allez dans l'onglet « NOS FONDS » et « Recherche de fonds ». (4) Recherchez le Produit à l'aide du code ISIN ou du nom du Produit et cliquez sur le Produit. (5) Cliquez sur l'onglet « Performances ».
- Le diagramme sur le site internet affiche la performance du Produit en pourcentage de perte ou de gain par an au cours des 10 dernières années par rapport à son indice de référence. Il peut vous aider à évaluer comment le Produit a été géré dans le passé et à le comparer à son indice de référence.
- Lorsque ce Produit est utilisé comme support en unité de compte d'un contrat d'assurance sur la vie ou de capitalisation, les informations complémentaires sur ce contrat, telles que les coûts du contrat, qui ne sont pas compris dans les coûts indiqués dans le présent document, le contact en cas de réclamation et ce qui se passe en cas de défaillance de l'entreprise d'assurance sont présentées dans le document d'informations clés de ce contrat obligatoirement remis par votre assureur ou courtier ou tout autre intermédiaire d'assurance conformément à son obligation légale.
- L'investisseur peut avoir recours au Médiateur de l'AMF par courrier postal : Le Médiateur - Autorité des marchés financiers - 17, place de la Bourse - 75082 Paris CEDEX 02 ou internet : <http://www.amf-france.org> /rubrique : Le Médiateur.



OBJECTIF

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

PRODUIT

BNP PARIBAS INDICE EURO, Part Privilege de classe C (FR0013276185)

Initiateur : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe (« BNPP AM »)

Site Internet : <https://www.bnpparibas-am.com>

Numéro de téléphone : appelez le +33.1.58.97.13.09 pour de plus amples informations.

L'Autorité des marchés financiers (« AMF ») est chargée du contrôle de BNPP AM en ce qui concerne ce document d'informations clés.

BNPP AM est agréée en France sous le n°GP96002 et réglementée par l'AMF.

Date de production du document d'informations clés : 01/03/2024

EN QUOI CONSISTE CE PRODUIT ?

Type

Ce Produit est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) nourricier. Il est constitué sous forme de fonds commun de placement (FCP) soumis aux dispositions du code monétaire et financier et à la directive OPCVM 2009/65/CE modifiée.

Un fonds nourricier est un fonds investi au minimum à 85% dans un seul autre OPC qui prend alors la qualification de fonds maître.

Durée

Ce Produit a été initialement créé pour une durée de 99 ans.

BNPP AM a le droit de procéder à la dissolution du Produit de manière unilatérale. La dissolution peut également intervenir en cas de fusion, de rachat total des parts ou lorsque l'actif net du Produit est inférieur au montant minimum réglementaire et, de dissolution du fonds maître.

Objectifs

Objectif de gestion : BNP PARIBAS INDICE EURO a pour classification Actions des pays de zone euro et est nourricier de la catégorie d'action EUR C/D du compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR, qui a pour objectif de gestion *de répliquer la performance de l'indice EURO STOXX® 50 Net Return, quelle que soit son évolution à la hausse comme à la baisse, avant prélèvement des frais de gestion et de fonctionnement. Le Compartiment étant indiciel, il a pour objectif de maintenir l'écart de suivi en valeur absolue entre l'évolution de la valeur liquidative du Compartiment et celle de l'indice à un niveau inférieur à 1%. Si cet écart de suivi dépasse 1%, il ne devra en tout état de cause pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.* La performance du Produit peut être inférieure à celle du compartiment maître en raison des frais de gestion propres au Produit.

Caractéristiques essentielles du Produit : Il est investi en totalité dans le compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF (compartiment maître) de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR et, à titre accessoire, en liquidités. L'indicateur de référence du compartiment maître et du Produit est l'indice EURO STOXX® 50 Net Return (code Bloomberg : SX5T Index), calculé dividendes nets réinvestis.

Le compartiment maître est dit à gestion indicelle et a pour objectif de respecter un écart de suivi maximum de 1%. Si l'écart de suivi devenait cependant supérieur à 1%, il ne devra pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.

L'actif du compartiment maître est composé de *titres de sociétés de tous secteurs, de grande et éventuellement moyenne capitalisation, émis sur les marchés d'un ou de plusieurs pays européens et dont la performance est destinée à être échangée contre une indexation à l'indicateur de référence.* Pour la gestion de sa trésorerie et/ou en fonction des conditions de marché, le compartiment maître *peut investir jusqu'à 15 % de son actif net en instruments du marché monétaire (bons du Trésor Français, titres de créances à court terme) ou en titres de créance négociables.*

Le compartiment maître est éligible au plan d'épargne en actions (PEA) et, en conséquence, maintient dans ses actifs au moins 75% de titres éligibles au PEA.

Le Produit est éligible au PEA.

Le Produit aura recours à des instruments dérivés tels que les futures et les options sur actions et indices boursiers. L'ensemble de ces instruments sera utilisé pour ajuster le risque actions.

Les demandes de rachat sont centralisées par BNP Paribas du lundi au vendredi à 13 heures, sont exécutées sur la base de la valeur liquidative datée du même jour et réglées dans les cinq jours suivant la date de calcul de la valeur liquidative.

Autres informations : Affectation des sommes distribuables : résultat net : capitalisation et plus-values nettes réalisées : capitalisation.

Ce Produit pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant cinq ans. Pour plus de détails, se reporter au prospectus du Produit.

Investisseurs de détail visés

Ce Produit est conçu pour des investisseurs qui n'ont ni expertise financière ni connaissance spécifique pour comprendre le Produit, mais peuvent néanmoins supporter une perte totale du capital. Il est approprié pour des clients cherchant à accroître leur capital. Les investisseurs potentiels devraient avoir un horizon de placement d'au moins 5 années. Le Produit n'est pas commercialisé auprès des investisseurs américains entrant dans la définition de restricted person telle que résumée dans le prospectus du Produit.

Informations pratiques

■ Dépositaire : BNP PARIBAS

■ Le prospectus, les documents d'informations clés relatifs aux autres parts de ce Produit, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques rédigés en langue française du Produit, sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.

■ Le prospectus, les statuts, le document d'informations clés, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques, rédigés en langue française, du fonds maître sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.



QUELS SONT LES RISQUES ET QU'EST-CE QUE CELA POURRAIT ME RAPPORTER ?

Indicateur de risque



L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit 5 années.

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 5 sur 7, qui est une classe de risque entre moyenne et élevée. L'investissement, à travers son fonds maître, dans des instruments de type actions justifie la catégorie de risque. Ceux-ci sont sujets à d'importantes fluctuations de cours souvent amplifiées à court terme. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau entre moyen et élevé et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est probable que la valeur de votre investissement en soit affectée au moment où vous demanderez le remboursement de vos parts.

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 contrepartie** : ce risque est associé à la capacité d'une contrepartie à une transaction financière de gré à gré d'honorer ses engagements comme le paiement, la livraison et le remboursement.

- **Risque de liquidité** : ce risque résulte de la difficulté de vendre un titre à sa juste valeur et dans un délai raisonnable du fait d'un manque d'acheteurs.

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.

Les ordres de souscription/rachat du Produit sont exécutés chaque jour, conformément aux modalités prévues dans son prospectus. Les ordres de souscription/rachat dans le fonds maître sont centralisés chaque jour ouvré, conformément aux modalités prévues dans son prospectus.

Scénarios de performance

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du Produit lui-même, mais pas nécessairement tous les coûts dus à votre conseiller ou distributeur. Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également influencer sur les montants que vous recevrez. Ce que vous obtiendrez de ce Produit dépend des performances futures du marché. L'évolution future du marché est aléatoire et ne peut être prédite avec précision. Les scénarios défavorable, intermédiaire et favorable présentés représentent des exemples utilisant les meilleures et pires performances, ainsi que la performance moyenne du Produit et/ou de l'indice de référence approprié au cours des 10 dernières années. Les marchés pourraient évoluer très différemment à l'avenir. Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

Période de détention recommandée : 5 ans

Exemple d'investissement : 10.000 EUR

Si vous sortez après 1 an

Si vous sortez après 5 ans

Scénarios

Minimum	Il n'existe aucun rendement minimal garanti. Vous pourriez perdre tout ou une partie de votre investissement.		
Tensions	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	5.269,7 EUR	1.348,81 EUR
	Rendement annuel moyen	-47,30%	-33,01%
Défavorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	8.167,18 EUR	8.438,77 EUR
	Rendement annuel moyen	-18,33%	-3,34%
Intermédiaire	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	10.381,22 EUR	12.475,16 EUR
	Rendement annuel moyen	3,81%	4,52%
Favorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	14.400,74 EUR	16.664,39 EUR
	Rendement annuel moyen	44,01%	10,75%

Le scénario favorable s'est produit pour un investissement entre 2018 et 2023.

Le scénario intermédiaire s'est produit pour un investissement entre 2014 et 2019.

Le scénario défavorable s'est produit pour un investissement entre 2015 et 2020.

QUE SE PASSE-T-IL SI BNPP AM N'EST PAS EN MESURE D'EFFECTUER LES VERSEMENTS ?

Le Produit est une copropriété d'instruments financiers et de dépôts distincte de BNPP AM.

En cas de défaillance de BNPP AM, les actifs du Produit conservés par le dépositaire ne seront pas affectés.

En cas de défaillance du dépositaire, le risque de perte financière du Produit est atténué en raison de la ségrégation légale des actifs du dépositaire de ceux du Produit.

QUE VA ME COÛTER CET INVESTISSEMENT ?

Il se peut que la personne qui vous vend ce Produit ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement.

Coûts au fil du temps

Les tableaux présentent les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez et du temps pendant lequel vous détenez le Produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles.

Nous avons supposé :

- qu'au cours de la première année, vous récupéreriez le montant que vous avez investi (rendement annuel de 0 %). Que pour les autres périodes de détention, le Produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire.
- que 10.000 EUR sont investis.



	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Coûts totaux	246,17 EUR	496,64 EUR
Incidence des coûts annuels (*)	2,47%	0,92% chaque année
(*) Elle montre dans quelle mesure les coûts réduisent annuellement votre rendement au cours de la période de détention. Par exemple, elle montre que si vous sortez à la fin de la période de détention recommandée, il est prévu que votre rendement moyen par an soit de 5,44% avant déduction des coûts et de 4,52% après cette déduction. Il se peut que nous partagions les coûts avec la personne qui vous vend le Produit afin de couvrir les services qu'elle vous fournit. Cette personne vous informera du montant.		
Composition des coûts		
Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie	Si vous sortez après 1 an	
Coûts d'entrée	Jusqu'à 2,00% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement.	Jusqu'à 200 EUR
Coûts de sortie	Nous ne facturons pas de coût de sortie pour ce Produit.	0 EUR
Coûts récurrents prélevés chaque année		
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation	0,46% de la valeur de votre investissement par an. Le montant se base sur une estimation du montant pouvant être prélevé sur votre capital.	45,08 EUR
Coûts de transaction	0,01% de la valeur de votre investissement par an. Il s'agit d'une estimation des coûts encourus lorsque nous achetons et vendons les investissements sous-jacents au Produit. Le montant réel varie en fonction de la quantité que nous achetons et vendons.	1,09 EUR
Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions		
Commissions liées aux résultats	Aucune commission liée aux résultats n'existe pour ce Produit.	0 EUR

COMBIEN DE TEMPS DOIS-JE LE CONSERVER, ET PUIS-JE RETIRER DE L'ARGENT DE FAÇON ANTICIPÉE ?

Période de détention recommandée : 5 ans.

La période de détention recommandée a été définie et se base sur le profil de risque et de rémunération du Produit.

Les investisseurs peuvent demander le rachat de leurs parts sur la base de la valeur liquidative dont les détails figurent dans le prospectus.

Tout rachat effectué avant la fin de la période de détention recommandée peut avoir un impact négatif sur le profil de performance du Produit et sur le profil de risque.

COMMENT PUIS-JE FORMULER UNE RECLAMATION ?

Pour toute réclamation, l'investisseur est invité à se rapprocher de son conseiller habituel auprès de l'établissement qui lui a conseillé le Produit. Il peut également s'adresser à BNPP AM via son site www.bnpparibas-am.fr (rubrique: « Politique de traitement des réclamations clients » en pied de page) ou adresser un courrier recommandé avec AR à BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, ou en envoyant un courriel à amfr.reclamations@bnpparibas.com.

AUTRES INFORMATIONS PERTINENTES

- Afin d'accéder aux performances et scénarios de performance passées du Produit, veuillez suivre les instructions ci-dessous : (1) Cliquez sur <https://www.bnpparibas-am.fr> (2) Dans la page d'accueil, allez dans « France » et sélectionnez la langue souhaitée ainsi que votre profil d'investisseur ; acceptez les termes et conditions du site internet. (3) Allez dans l'onglet « NOS FONDS » et « Recherche de fonds ». (4) Recherchez le Produit à l'aide du code ISIN ou du nom du Produit et cliquez sur le Produit. (5) Cliquez sur l'onglet « Performances ».
- Le diagramme sur le site internet affiche la performance du Produit en pourcentage de perte ou de gain par an au cours des 5 dernières années par rapport à son indice de référence. Il peut vous aider à évaluer comment le Produit a été géré dans le passé et à le comparer à son indice de référence.
- Lorsque ce Produit est utilisé comme support en unité de compte d'un contrat d'assurance sur la vie ou de capitalisation, les informations complémentaires sur ce contrat, telles que les coûts du contrat, qui ne sont pas compris dans les coûts indiqués dans le présent document, le contact en cas de réclamation et ce qui se passe en cas de défaillance de l'entreprise d'assurance sont présentées dans le document d'informations clés de ce contrat obligatoirement remis par votre assureur ou courtier ou tout autre intermédiaire d'assurance conformément à son obligation légale.
- L'investisseur peut avoir recours au Médiateur de l'AMF par courrier postal : Le Médiateur - Autorité des marchés financiers - 17, place de la Bourse - 75082 Paris CEDEX 02 ou internet : <http://www.amf-france.org> /rubrique : Le Médiateur.



OBJECTIF

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

PRODUIT

BNP PARIBAS INDICE EURO, Part Privilege de classe D (FR0013276193)

Initiateur : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe (« BNPP AM »)

Site Internet : <https://www.bnpparibas-am.com>

Numéro de téléphone : appelez le +33.1.58.97.13.09 pour de plus amples informations.

L'Autorité des marchés financiers (« AMF ») est chargée du contrôle de BNPP AM en ce qui concerne ce document d'informations clés.

BNPP AM est agréée en France sous le n°GP96002 et réglementée par l'AMF.

Date de production du document d'informations clés : 01/03/2024

EN QUOI CONSISTE CE PRODUIT ?

Type

Ce Produit est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) nourricier. Il est constitué sous forme de fonds commun de placement (FCP) soumis aux dispositions du code monétaire et financier et à la directive OPCVM 2009/65/CE modifiée.

Un fonds nourricier est un fonds investi au minimum à 85% dans un seul autre OPC qui prend alors la qualification de fonds maître.

Durée

Ce Produit a été initialement créé pour une durée de 99 ans.

BNPP AM a le droit de procéder à la dissolution du Produit de manière unilatérale. La dissolution peut également intervenir en cas de fusion, de rachat total des parts ou lorsque l'actif net du Produit est inférieur au montant minimum réglementaire et, de dissolution du fonds maître.

Objectifs

Objectif de gestion : BNP PARIBAS INDICE EURO a pour classification Actions des pays de zone euro et est nourricier de la catégorie d'action EUR C/D du compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR, qui a pour objectif de gestion *de répliquer la performance de l'indice EURO STOXX® 50 Net Return, quelle que soit son évolution à la hausse comme à la baisse, avant prélèvement des frais de gestion et de fonctionnement. Le Compartiment étant indiciel, il a pour objectif de maintenir l'écart de suivi en valeur absolue entre l'évolution de la valeur liquidative du Compartiment et celle de l'indice à un niveau inférieur à 1%. Si cet écart de suivi dépasse 1%, il ne devra en tout état de cause pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.* La performance du Produit peut être inférieure à celle du compartiment maître en raison des frais de gestion propres au Produit.

Caractéristiques essentielles du Produit : Il est investi en totalité dans le compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF (compartiment maître) de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR et, à titre accessoire, en liquidités. L'indicateur de référence du compartiment maître et du Produit est l'indice EURO STOXX® 50 Net Return (code Bloomberg : SX5T Index), calculé dividendes nets réinvestis.

Le compartiment maître est dit à gestion indicelle et a pour objectif de respecter un écart de suivi maximum de 1%. Si l'écart de suivi devenait cependant supérieur à 1%, il ne devra pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.

L'actif du compartiment maître est composé de *titres de sociétés de tous secteurs, de grande et éventuellement moyenne capitalisation, émis sur les marchés d'un ou de plusieurs pays européens et dont la performance est destinée à être échangée contre une indexation à l'indicateur de référence.* Pour la gestion de sa trésorerie et/ou en fonction des conditions de marché, le compartiment maître *peut investir jusqu'à 15 % de son actif net en instruments du marché monétaire (bons du Trésor Français, titres de créances à court terme) ou en titres de créance négociables.*

Le compartiment maître est éligible au plan d'épargne en actions (PEA) et, en conséquence, maintient dans ses actifs au moins 75% de titres éligibles au PEA.

Le Produit est éligible au PEA.

Le Produit aura recours à des instruments dérivés tels que les futures et les options sur actions et indices boursiers. L'ensemble de ces instruments sera utilisé pour ajuster le risque actions.

Les demandes de rachat sont centralisées par BNP Paribas du lundi au vendredi à 13 heures, sont exécutées sur la base de la valeur liquidative datée du même jour et réglées dans les cinq jours suivant la date de calcul de la valeur liquidative.

Autres informations : Affectation des sommes distribuables : résultat net : distribution et plus-values nettes réalisées : capitalisation.

Ce Produit pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant cinq ans. Pour plus de détails, se reporter au prospectus du Produit.

Investisseurs de détail visés

Ce Produit est conçu pour des investisseurs qui n'ont ni expertise financière ni connaissance spécifique pour comprendre le Produit, mais peuvent néanmoins supporter une perte totale du capital. Il est approprié pour des clients cherchant à accroître et/ou percevoir des revenus de leur capital. Les investisseurs potentiels devraient avoir un horizon de placement d'au moins 5 années. Le Produit n'est pas commercialisé auprès des investisseurs américains entrant dans la définition de restricted person telle que résumée dans le prospectus du Produit.

Informations pratiques

■ Dépositaire : BNP PARIBAS

■ Le prospectus, les documents d'informations clés relatifs aux autres parts de ce Produit, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques rédigés en langue française du Produit, sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.

■ Le prospectus, les statuts, le document d'informations clés, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques, rédigés en langue française, du fonds maître sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.



QUELS SONT LES RISQUES ET QU'EST-CE QUE CELA POURRAIT ME RAPPORTER ?

Indicateur de risque



L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit 5 années.

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 5 sur 7, qui est une classe de risque entre moyenne et élevée. L'investissement, à travers son fonds maître, dans des instruments de type actions justifie la catégorie de risque. Ceux-ci sont sujets à d'importantes fluctuations de cours souvent amplifiées à court terme. Autrement dit, les pertes potentielles liées aux futurs résultats du produit se situent à un niveau entre moyen et élevé et, si la situation venait à se détériorer sur les marchés, il est probable que la valeur de votre investissement en soit affectée au moment où vous demanderez le remboursement de vos parts.

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 contrepartie** : ce risque est associé à la capacité d'une contrepartie à une transaction financière de gré à gré d'honorer ses engagements comme le paiement, la livraison et le remboursement.

- **Risque de liquidité** : ce risque résulte de la difficulté de vendre un titre à sa juste valeur et dans un délai raisonnable du fait d'un manque d'acheteurs.

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.

Les ordres de souscription/rachat du Produit sont exécutés chaque jour, conformément aux modalités prévues dans son prospectus. Les ordres de souscription/rachat dans le fonds maître sont centralisés chaque jour ouvré, conformément aux modalités prévues dans son prospectus.

Scénarios de performance

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du Produit lui-même, mais pas nécessairement tous les coûts dus à votre conseiller ou distributeur. Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également influencer sur les montants que vous recevrez. Ce que vous obtiendrez de ce Produit dépend des performances futures du marché. L'évolution future du marché est aléatoire et ne peut être prédite avec précision. Les scénarios défavorable, intermédiaire et favorable présentés représentent des exemples utilisant les meilleures et pires performances, ainsi que la performance moyenne du Produit et/ou de l'indice de référence approprié au cours des 10 dernières années. Les marchés pourraient évoluer très différemment à l'avenir. Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

Période de détention recommandée : 5 ans

Exemple d'investissement : 10.000 EUR

Si vous sortez après 1 an

Si vous sortez après 5 ans

Scénarios

Minimum	Il n'existe aucun rendement minimal garanti. Vous pourriez perdre tout ou une partie de votre investissement.		
Tensions	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	5.269,7 EUR	1.348,81 EUR
	Rendement annuel moyen	-47,30%	-33,01%
Défavorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	8.167,18 EUR	8.438,77 EUR
	Rendement annuel moyen	-18,33%	-3,34%
Intermédiaire	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	10.381,22 EUR	12.475,16 EUR
	Rendement annuel moyen	3,81%	4,52%
Favorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	14.400,74 EUR	16.664,39 EUR
	Rendement annuel moyen	44,01%	10,75%

Le scénario favorable s'est produit pour un investissement entre 2018 et 2023.

Le scénario intermédiaire s'est produit pour un investissement entre 2014 et 2019.

Le scénario défavorable s'est produit pour un investissement entre 2015 et 2020.

QUE SE PASSE-T-IL SI BNPP AM N'EST PAS EN MESURE D'EFFECTUER LES VERSEMENTS ?

Le Produit est une copropriété d'instruments financiers et de dépôts distincte de BNPP AM.

En cas de défaillance de BNPP AM, les actifs du Produit conservés par le dépositaire ne seront pas affectés.

En cas de défaillance du dépositaire, le risque de perte financière du Produit est atténué en raison de la ségrégation légale des actifs du dépositaire de ceux du Produit.

QUE VA ME COÛTER CET INVESTISSEMENT ?

Il se peut que la personne qui vous vend ce Produit ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement.

Coûts au fil du temps

Les tableaux présentent les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez et du temps pendant lequel vous détenez le Produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles.

Nous avons supposé :

- qu'au cours de la première année, vous récupéreriez le montant que vous avez investi (rendement annuel de 0 %). Que pour les autres périodes de détention, le Produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire.
- que 10.000 EUR sont investis.



	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Coûts totaux	246,17 EUR	496,64 EUR
Incidence des coûts annuels (*)	2,47%	0,92% chaque année
(*) Elle montre dans quelle mesure les coûts réduisent annuellement votre rendement au cours de la période de détention. Par exemple, elle montre que si vous sortez à la fin de la période de détention recommandée, il est prévu que votre rendement moyen par an soit de 5,44% avant déduction des coûts et de 4,52% après cette déduction. Il se peut que nous partagions les coûts avec la personne qui vous vend le Produit afin de couvrir les services qu'elle vous fournit. Cette personne vous informera du montant.		
Composition des coûts		
Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie	Si vous sortez après 1 an	
Coûts d'entrée	Jusqu'à 2,00% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement.	Jusqu'à 200 EUR
Coûts de sortie	Nous ne facturons pas de coût de sortie pour ce Produit.	0 EUR
Coûts récurrents prélevés chaque année		
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation	0,46% de la valeur de votre investissement par an. Le montant se base sur une estimation du montant pouvant être prélevé sur votre capital.	45,08 EUR
Coûts de transaction	0,01% de la valeur de votre investissement par an. Il s'agit d'une estimation des coûts encourus lorsque nous achetons et vendons les investissements sous-jacents au Produit. Le montant réel varie en fonction de la quantité que nous achetons et vendons.	1,09 EUR
Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions		
Commissions liées aux résultats	Aucune commission liée aux résultats n'existe pour ce Produit.	0 EUR

COMBIEN DE TEMPS DOIS-JE LE CONSERVER, ET PUIS-JE RETIRER DE L'ARGENT DE FAÇON ANTICIPÉE ?

Période de détention recommandée : 5 ans.

La période de détention recommandée a été définie et se base sur le profil de risque et de rémunération du Produit.

Les investisseurs peuvent demander le rachat de leurs parts sur la base de la valeur liquidative dont les détails figurent dans le prospectus.

Tout rachat effectué avant la fin de la période de détention recommandée peut avoir un impact négatif sur le profil de performance du Produit et sur le profil de risque.

COMMENT PUIS-JE FORMULER UNE RECLAMATION ?

Pour toute réclamation, l'investisseur est invité à se rapprocher de son conseiller habituel auprès de l'établissement qui lui a conseillé le Produit. Il peut également s'adresser à BNPP AM via son site www.bnpparibas-am.fr (rubrique: « Politique de traitement des réclamations clients » en pied de page) ou adresser un courrier recommandé avec AR à BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, ou en envoyant un courriel à amfr.reclamations@bnpparibas.com.

AUTRES INFORMATIONS PERTINENTES

- Afin d'accéder aux performances et scénarios de performance passées du Produit, veuillez suivre les instructions ci-dessous : (1) Cliquez sur <https://www.bnpparibas-am.fr> (2) Dans la page d'accueil, allez dans « France » et sélectionnez la langue souhaitée ainsi que votre profil d'investisseur ; acceptez les termes et conditions du site internet. (3) Allez dans l'onglet « NOS FONDS » et « Recherche de fonds ». (4) Recherchez le Produit à l'aide du code ISIN ou du nom du Produit et cliquez sur le Produit. (5) Cliquez sur l'onglet « Performances ».
- Le diagramme sur le site internet affiche la performance du Produit en pourcentage de perte ou de gain par an au cours des 5 dernières années par rapport à son indice de référence. Il peut vous aider à évaluer comment le Produit a été géré dans le passé et à le comparer à son indice de référence.
- Lorsque ce Produit est utilisé comme support en unité de compte d'un contrat d'assurance sur la vie ou de capitalisation, les informations complémentaires sur ce contrat, telles que les coûts du contrat, qui ne sont pas compris dans les coûts indiqués dans le présent document, le contact en cas de réclamation et ce qui se passe en cas de défaillance de l'entreprise d'assurance sont présentées dans le document d'informations clés de ce contrat obligatoirement remis par votre assureur ou courtier ou tout autre intermédiaire d'assurance conformément à son obligation légale.
- L'investisseur peut avoir recours au Médiateur de l'AMF par courrier postal : Le Médiateur - Autorité des marchés financiers - 17, place de la Bourse - 75082 Paris CEDEX 02 ou internet : <http://www.amf-france.org> /rubrique : Le Médiateur.





BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

PROSPECTUS DU FCP
BNP PARIBAS INDICE EURO

FCP RELEVANT DE LA DIRECTIVE EUROPEENNE 2009/65/CE

PROSPECTUS DU FCP
BNP PARIBAS INDICE EURO

I. CARACTERISTIQUES GENERALES

I.1 - FORME DE L'OPCVM

DENOMINATION : BNP PARIBAS INDICE EURO

FORME JURIDIQUE ET ETAT MEMBRE DANS LEQUEL L'OPCVM A ETE CONSTITUE : Fonds commun de placement (FCP) constitué en France.

NOURRICIER : Le FCP est un nourricier du compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR.

DATE DE CREATION ET DUREE D'EXISTENCE PREVUE : FCP créé le 22 juillet 2004 pour une durée de 99 ans. Il a été agréé par l'Autorité des marchés financiers (AMF) le 29 juin 2004.

SYNTHESE DE L'OFFRE DE GESTION :

Catégories de parts	Codes ISIN	Affectation des sommes distribuables	Devise de libellé	Souscripteurs concernés	Fractionnement des parts	Montant minimum des souscriptions
Catégorie de part « Classic » de classe « D »	FR0010536144	Résultat net : Distribution Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Tous souscripteurs. Principalement personnes physiques.	Millième de part	Un millième de part
Catégorie de part « Classic » de classe « C »	FR0011538230	Résultat net : Capitalisation Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Tous souscripteurs. Principalement personnes physiques.	Millième de part	Un millième de part
Catégorie de part « Privilège » de classe « D »	FR0013276193	Résultat net : Distribution Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Réservée aux souscripteurs conseillés par des conseils indépendants au sens de MIF 2 (1) et à la gestion sous mandat (GSM)	Millième de part	Un millième de part
Catégorie de part « Privilège » de classe « C »	FR0013276185	Résultat net : Capitalisation Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Réservée aux souscripteurs conseillés par des conseils indépendants au sens de MIF 2 (1) et à la gestion sous mandat (GSM)	Millième de part	Un millième de part

(1) Distributeurs de pays membres de l'Espace Economique Européen fournissant uniquement un service de conseil indépendant au sens de la Directive MIF 2004/39.

LIEU OU L'ON PEUT SE PROCURER LE DERNIER RAPPORT ANNUEL, LE DERNIER ETAT PERIODIQUE ET LA VALEUR LIQUIDATIVE:

Les derniers documents annuels ainsi que la composition des actifs sont adressés dans un délai de huit jours ouvrés sur simple demande écrite auprès de :

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client
TSA 90007 – 92729 Nanterre CEDEX

Ces documents sont également disponibles sur le site « www.bnpparibas-am.com ».

Les derniers documents annuels ainsi que la composition des actifs du compartiment maître BNP PARIBAS EASY EURO STOXX® 50 UCITS ETF de la SICAV BNP Paribas Easy FR sont adressés dans un délai de huit jours ouvrés sur simple demande écrite du porteur auprès de :

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client
TSA 90007 – 92729 Nanterre CEDEX

Des explications supplémentaires peuvent être obtenues si nécessaire auprès de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe.

Le site de l'AMF www.amf-france.org contient des informations complémentaires sur la liste des documents réglementaires et l'ensemble des dispositions relatives à la protection des investisseurs.

I.2 – ACTEURS**SOCIETE DE GESTION :****BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe**

Société par Actions Simplifiée

Siège social : 1, Boulevard Haussmann - 75009 Paris

Adresse postale : TSA 90007 – 92729 Nanterre CEDEX

Société de gestion de portefeuille agréée par l'Autorité des marchés financiers (AMF) le 19 avril 1996 sous le n° GP 96002 - N° ADEME : FR200182_03KLJL

DEPOSITAIRE ET CONSERVATEUR :**BNP Paribas**

Société anonyme

Siège social : 16, boulevard des Italiens - 75009 Paris

Adresse des bureaux : Grands Moulins de Pantin

9, rue du Débarcadère - 93500 Pantin

Etablissement de crédit agréé par l'Autorité de contrôle prudentiel et de résolution

Les fonctions du dépositaire recouvrent la conservation des actifs, le contrôle de la régularité des décisions de la société de gestion et le suivi des flux de liquidités du FCP. Des conflits d'intérêts potentiels peuvent exister notamment dans le cas où BNP Paribas entretient des relations commerciales avec la société de gestion en complément de sa fonction de dépositaire du FCP. Il peut en être ainsi lorsque BNP Paribas offre au FCP des services d'administration de fonds incluant le calcul des valeurs liquidatives.

Le dépositaire délègue la conservation des actifs devant être conservés à l'étranger à des sous-conservateurs locaux dans les Etats où il n'a pas de présence locale. La rémunération des sous-conservateurs est prise sur la commission versée au dépositaire et aucuns frais supplémentaires ne sont supportés par le porteur au titre de cette fonction. Le processus de désignation et de supervision des sous-conservateurs suit les plus hauts standards de qualité, incluant la gestion des conflits d'intérêts potentiels qui pourraient survenir à l'occasion de ces délégations. La liste des sous-conservateurs est disponible à l'adresse suivante : <http://securities.bnpparibas.com/solutions/asset-fund-services/depositary-bank-and-trustee-serv.html>.

**CENTRALISATEUR DES ORDRES
DE SOUSCRIPTION OU DE RACHAT
PAR DELEGATION :**

BNP Paribas

**TENEUR DE COMPTE EMETTEUR
PAR DELEGATION :**

BNP Paribas

COMMISSAIRE AUX COMPTES :

PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT
63, rue de Villiers
92208 Neuilly sur Seine Cedex

Représenté par M. Amaury COUPLEZ

Le commissaire aux comptes certifie la régularité et la sincérité des comptes du FCP. Il contrôle la composition de l'actif ainsi que les informations de nature financière et comptable avant leur publication.

COMMERCIALISATEUR :

BNP Paribas
Société Anonyme
16, Boulevard des Italiens – 75009 Paris
et les sociétés du groupe BNP Paribas

Le FCP étant admis en Euroclear France, ses parts peuvent être souscrites ou rachetées auprès d'intermédiaires financiers qui ne sont pas connus de la société de gestion.

DELEGATAIRE DE LA GESTION COMPTABLE :

BNP Paribas
Société anonyme
Siège social : 16, boulevard des Italiens - 75009 Paris
Adresse des bureaux : Grands Moulins de Pantin
9, rue du Débarcadère - 93500 Pantin

Le délégué de la gestion comptable assure les fonctions d'administration des fonds (comptabilisation, calcul de la valeur liquidative).

CONSEILLER :

Néant

II. MODALITES DE FONCTIONNEMENT ET DE GESTION

II.1 - CARACTERISTIQUES GENERALES

CARACTERISTIQUES DES PARTS :

NATURE DU DROIT ATTACHE AUX PARTS :

Chaque porteur de parts dispose d'un droit de copropriété sur les actifs du FCP proportionnel au nombre de parts possédées.

PRECISIONS SUR LES MODALITES DE GESTION DU PASSIF :

Dans le cadre de la gestion du passif du FCP, les fonctions de centralisation des ordres de souscription et de rachat, ainsi que de tenue de compte émetteur des parts sont effectuées par le dépositaire en relation avec la société Euroclear France, auprès de laquelle le FCP est admis.

FORME DES PARTS :

Nominatif administré, nominatif pur, ou au porteur. Le FCP est admis en Euroclear France.

DROIT DE VOTE :

S'agissant d'un FCP, aucun droit de vote n'est attaché aux parts, les décisions étant prises par la société de gestion.

Toutefois, une information sur les modifications du fonctionnement du FCP est donnée aux porteurs soit individuellement, soit par voie de presse, soit par tout autre moyen conformément à l'instruction AMF n°2011-19.

DECIMALISATION :

Les parts du FCP sont décimalisées en millièmes.

DATE DE CLOTURE DE L'EXERCICE :

Dernier jour de Bourse du mois de décembre.

Premier exercice : dernier jour de Bourse du mois de décembre 2005.

INDICATIONS SUR LE REGIME FISCAL :

DOMINANTE FISCALE : Ce FCP est éligible au Plan d'Epargne en Actions (PEA).

Régime des plus-values de cession de valeurs mobilières et droits sociaux applicable aux personnes physiques ayant leur domicile fiscal en France, à savoir :

- Par défaut : Prélèvement Forfaitaire Unique (PFU) de 30 % (12,8 % au titre de l'impôt sur le revenu et 17,2 % au titre des prélèvements sociaux) ;
- Sur option exercée au moment de la déclaration de revenus : imposition au barème progressif de l'impôt sur le revenu avec la possibilité, le cas échéant, de bénéficier de l'abattement pour durée de détention dont dispose l'article 150-0 D du Code général des impôts (de 50 % pour une détention des actions depuis au moins 2 ans et moins de 8 ans, et de 65 % pour une détention des actions depuis au moins 8 ans) lorsque les titres ont été acquis ou souscrits avant le 1er janvier 2018. L'option pour le barème progressif de l'impôt sur le revenu est globale et vaut pour l'ensemble des revenus, gains nets, profits et créances entrant dans le champ d'application du PFU. S'ajoutent les prélèvements sociaux au taux global de 17,2 %, dont une proportion de CSG est cependant déductible du revenu global imposable de l'année de son paiement.

Le FCP n'est pas assujéti à l'impôt sur les sociétés. Cependant, les distributions et les plus-values sont imposables entre les mains de ses porteurs.

Le régime fiscal applicable aux sommes distribuées par le FCP et aux plus ou moins-values latentes ou réalisées par le FCP dépend des dispositions fiscales applicables à la situation particulière de l'investisseur et/ou de celles en vigueur dans le pays où investit le FCP. La détention de parts du FCP via un PEA permet, sous réserve du respect de certaines conditions, une exonération d'impôt sur les plus-values de cession de valeurs mobilières.

L'attention de l'investisseur est spécialement attirée sur tout élément concernant sa situation particulière. Le cas échéant, en cas d'incertitude sur sa situation fiscale, il doit s'adresser à un conseiller fiscal professionnel.

II.2 - DISPOSITIONS PARTICULIERES

CODES ISIN :

Catégorie de part « Classic » de classe « D » : FR0010536144

Catégorie de part « Classic » de classe « C » : FR0011538230

Catégorie de part « Privilege » de classe « D » : FR0013276193

Catégorie de part « Privilege » de classe « C » : FR0013276185

CLASSIFICATION : Actions des pays de la zone Euro

Le degré d'exposition minimum du FCP aux marchés d'actions est de 90% de l'actif net.

OBJECTIF DE GESTION :

Le FCP est nourricier de la catégorie d'action « EUR C/D » du compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF de la SICAV BNP Paribas Easy FR dont l'objectif de gestion « est de répliquer la performance de l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return, quelle que soit son évolution à la hausse comme à la baisse, avant prélèvement des frais de gestion et de fonctionnement. Le Compartiment étant indiciel, il a pour objectif de maintenir l'écart de suivi en valeur absolue entre l'évolution de la valeur liquidative du Compartiment et celle de l'indice à un niveau inférieur à 1%. Si cet écart de suivi dépasse 1%, il ne devra en tout état de cause pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines. »

La performance du FCP peut être inférieure à celle du compartiment maître, en raison des frais de gestion propres au FCP.

INDICATEUR DE REFERENCE :

L'indicateur de référence du compartiment maître et du FCP est l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return, calculé dividendes nets réinvestis, publié en euro par Stox Limited (Code Bloomberg : SX5T Index).

L'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return est un indice de référence boursier calculé comme la moyenne arithmétique pondérée par les capitalisations d'un échantillon de 50 actions sélectionnées parmi les pays appartenant à la zone Euro.

Les actions entrant dans la composition de l'indice sont sélectionnées pour leur niveau de capitalisation, leur liquidité et leur représentativité sectorielle.

L'indice est calculé et publié par la société STOXX Limited.

Conformément au règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2016, l'administrateur de l'indice est inscrit sur le registre des administrateurs et des indices de référence tenu par l'Autorité Européenne des Marchés Financiers.

Par ailleurs, en application de ce même règlement, la société de gestion dispose d'une procédure de suivi des indices de référence utilisés décrivant les mesures à mettre en œuvre en cas de modifications substantielles apportées à un indice ou de cessation de fourniture de cet indice.

Avertissement de Stox Limited :

L'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return est protégé par la législation sur la propriété intellectuelle.

EURO STOXX[®] 50 Net Return est une marque déposée de STOXX Limited et fait l'objet d'une licence d'utilisation accordée à BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe (le détenteur).

STOXX et ses concédants n'ont pas d'autre lien avec le détenteur de licence qui a été attribuée pour l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return et les marques déposées à des fins d'utilisation en rapport avec BNP PARIBAS EASY EURO STOXX[®] 50 UCITS ETF.

STOXX et ses concédants:

ne font aucune déclaration de garantie quant à l'opportunité d'une transaction sur les actions du Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF qu'ils s'abstiennent également de vendre et de promouvoir.

Ne délivrent aucune recommandation d'investissement à quiconque en ce qui concerne le Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF ou d'autres titres que ce soit.

N'endossent aucune responsabilité ni obligation quant à la date de lancement, la quantité et le prix des parts du Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF, et ne prennent aucune décision à ce sujet.

N'endossent aucune responsabilité ni obligation concernant l'administration, la gestion ou la commercialisation du Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF.

Ne sont pas tenus de prendre en considération les besoins du Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ou de ses détenteurs de parts pour déterminer, composer ou calculer l'indice Euro STOXX[®] 50 Net Return.

STOXX et ses concédants déclinent toute responsabilité relative au Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF. Plus particulièrement, STOXX et ses concédants ne fournissent ni n'assurent aucune garantie, expresse ou implicite, et n'assument aucune garantie expresse ou implicite, que ce soit concernant:

- **Les résultats devant être obtenus par le Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF, le détenteur d'actions du Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF ou toute personne impliquée dans l'utilisation de l'indice Euro STOXX[®] 50 Net Return et des données incluses avec l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return;**
- **L'exactitude ou l'exhaustivité de l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return et des données qu'il contient;**
- **La négociabilité de l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return et de ses données ainsi que leur adéquation à un usage précis ou à une fin particulière;**
- **STOXX et ses concédants ne peuvent être tenus pour responsables de quelque erreur, omission ou interruption que ce soit dans l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return ou les données qu'il contient;**
- **En aucun cas, STOXX ou ses concédants ne peuvent être tenus pour responsables de quelque manque à gagner que ce soit. Il en va de même pour tout dommage ou perte indirects même si STOXX et ses concédants ont été avertis de l'existence de tels risques.**

Le contrat de licence entre BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe et STOXX a été établi dans leur seul intérêt et non dans celui des actionnaires du Compartiment BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF ou de tiers.

Une description exhaustive de l'indice ainsi que la publication de ses valeurs est disponible sur le site internet www.stoxx.com

STRATEGIE D'INVESTISSEMENT :

1. STRATEGIE UTILISEE POUR ATTEINDRE L'OBJECTIF DE GESTION

Le FCP BNP PARIBAS INDICE EURO est nourricier de la catégorie d'action « EUR C/D » du compartiment « BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF » de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR dit compartiment maître. BNP PARIBAS INDICE EURO est investi en totalité en actions du compartiment « BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF » et à titre accessoire en liquidités et/ou en contrats financiers.

Rappel de la stratégie d'investissement du compartiment maître :

Pour atteindre l'objectif de gestion d'offrir aux investisseurs l'exposition à l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return, le Compartiment peut utiliser soit la méthodologie de réplication dite « synthétique », soit une méthodologie de réplication directe de l'indicateur de référence.

Pour atteindre son objectif de gestion, le Compartiment investit essentiellement dans les actions composant l'indicateur de référence défini ci-dessus, en respectant la mise en œuvre par ce dernier dans le choix des actions. Si la composition venait à changer, le Compartiment répliquerait la nouvelle répartition suivie par l'indicateur de référence.

Toutefois, la société de gestion peut utiliser des techniques et des instruments financiers négociables dont il estime qu'ils sont économiquement appropriés à la gestion optimale de portefeuille (achats/ventes d'instruments financiers réglementés ou de gré à gré, souscriptions/rachats de parts ou d'actions français ou européens coordonnés, utilisation d'instruments financiers à terme).

Ainsi, les caractéristiques de risque de marché du portefeuille sont similaires à celles de l'indicateur de référence.

La société de gestion pourra, conformément à la réglementation en vigueur, remplacer l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return en cas d'événements significatifs affectant le fonctionnement de l'indice (cessation de publication, disparition de l'indice) ou dans le cas où les conditions de sa réplication ne seraient plus optimales en vue de la réalisation de l'objectif de gestion.

Information relative aux règlements SFDR et Taxonomie :

Le règlement 2019/2088 du Parlement Européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR) établit des règles de transparence et de fourniture d'informations en matière de durabilité.

Ce Compartiment ne relève ni de l'article 8 (OPC promouvant des caractéristiques environnementales ou sociales) ni de l'article 9 (OPC investissant dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental) du règlement européen du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers.

Afin d'atteindre son objectif de gestion et de maintenir un écart de suivi faible par rapport à son indicateur de référence, le processus d'investissement ne prendra pas en compte les risques de durabilité, ni les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité.

L'indicateur de référence retenu n'intègre pas de critères de durabilité.

Le risque de durabilité est défini comme étant un événement ou une situation dans le domaine environnemental, social ou de la gouvernance qui, s'il survient, pourrait avoir une incidence négative importante, réelle ou potentielle, sur la valeur du Compartiment.

Le règlement 2020/852 du Parlement Européen et du Conseil du 18 juin 2020 sur l'établissement d'un cadre visant à favoriser les investissements durables et modifiant le règlement SFDR (Règlement Taxonomie) a pour objectif d'établir les critères permettant de déterminer si une activité économique est considérée comme durable sur le plan environnemental.

La taxonomie européenne est un système de classification établissant une liste d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Les activités économiques qui ne sont pas reconnues par le Règlement Taxonomie, ne sont pas nécessairement nuisibles à l'environnement ou non durables. Par ailleurs, d'autres activités pouvant apporter une contribution substantielle aux objectifs environnementaux et sociaux ne font pas encore nécessairement partie du Règlement Taxonomie.

Les investissements du Compartiment ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental établis par le Règlement Taxonomie.

2. PRINCIPALES CATEGORIES D'ACTIFS UTILISES (HORS DERIVES INTEGRES)

- **Actions :**

Rappel des principales catégories d'actifs utilisés (hors dérivés intégrés) du compartiment maître :

Le Compartiment est éligible au Plan d'Épargne en actions « PEA » et en conséquence maintient dans ses actifs au moins 75% de titres éligibles au PEA.

Le Compartiment investit dans des titres de sociétés de tous secteurs, de grande et éventuellement moyenne capitalisation, émis sur les marchés d'un ou de plusieurs pays européens et dont la performance est destinée à être échangée contre une indexation à l'indicateur de référence.

Le Compartiment peut investir en actions dans le cadre des ratios dérogatoires des OPCVM indiciels, soit jusqu'à 20% de son actif net en actions d'une même entité émettrice, dans le respect des conditions détaillées à l'article R214-22 §1 du code monétaire et financier. Lorsque des conditions exceptionnelles sur le marché le justifient, notamment lorsque certaines valeurs sont dominantes, cette limite de 20% peut être portée à 35% pour une seule entité émettrice.

- **Titres de créances et instruments du marché monétaire :**

Pour la gestion de sa trésorerie et/ou en fonction des conditions de marché, le Compartiment peut investir jusqu'à 15 % de son actif net en instruments du marché monétaire (Bons du Trésor Français, de titres de créances à court terme) ou en titres de créance négociables.

Ces instruments bénéficient lors de leur acquisition d'une notation minimale A-3 (Standard & Poor's) ou P-3 (Moody's) ou à défaut d'une notation « long term investment grade » ou d'une notation interne à la société de gestion qui répond à des critères équivalents.

Les émetteurs sélectionnés peuvent aussi bien relever du secteur privé que du secteur public (États, collectivités territoriales, ...), les dettes privées étant susceptibles de représenter jusqu'à 100% de l'actif net des instruments de dette.

Les obligations ou titres de créances négociables ou complexes étrangers seront libellés en euro.

- **Parts ou actions d'organismes de placement collectif :**

Le Compartiment peut investir jusqu'à 10% de son actif net en parts ou actions d'OPCVM, de FIA et de fonds d'investissement.

Les OPCVM, FIA et fonds d'investissement sont :

- des OPCVM de droit français ou étranger;
- des FIA de droit français ou FIA établis dans d'autres Etats membres de l'Union Européenne ou de fonds d'investissement constitués sur le fondement d'un droit étranger respectant les critères définis à l'article R 214-13 du code monétaire et financier.

Ces OPCVM, FIA et fonds d'investissement peuvent être gérés par des sociétés de gestion du groupe BNP Paribas.

- **Instruments dérivés :**

Le Compartiment peut utiliser des instruments négociés sur les marchés à terme réglementés français et/ou étrangers conformément à la réglementation, tels que des futures et des options. Le Compartiment peut également conclure des contrats financiers négociés de gré à gré (swap) pour réaliser son objectif de gestion.

Les instruments financiers à terme utilisés permettant au Compartiment de s'exposer à la stratégie d'investissement en vue de réaliser l'objectif de gestion seront :

- des options de gré à gré ;
- des contrats d'échange de flux financiers : swap de performance portant sur l'indicateur de référence, equity swap ;
- des contrats à terme de couverture de change, swap de change.

Dans le cas où le Compartiment met en œuvre des techniques de réplique synthétique, il a recourt à des contrats d'échange de flux financiers afin de réaliser son objectif de gestion. Le Compartiment peut donc conclure notamment des contrats d'échange sur rendement global (Total Return Swap) échangeant la performance de l'actif du Compartiment contre un taux fixe ou un taux variable ou plusieurs contrats d'échange de flux financiers échangeant un taux fixe ou un taux variable contre la performance de l'indice EURO STOXX 50[®] Net Return.

La proportion maximale d'actifs sous gestion pouvant faire l'objet d'un Total Return Swap :

- afin d'échanger la performance de l'actif du Compartiment contre un taux fixe ou un taux variable est égal à 115% de l'actif net,
- afin de réaliser l'objectif de gestion du Compartiment est égal à 115% de l'actif net,

La proportion attendue d'actifs sous gestion qui feront l'objet d'un Total Return Swap :

- afin d'échanger la performance de l'actif du Compartiment contre un taux fixe ou un taux variable est égal à 0% de l'actif net,
- afin de réaliser l'objectif de gestion du Compartiment est égal à 0% de l'actif net,

Ces instruments financiers peuvent être conclus avec des contreparties sélectionnées par la société de gestion conformément à sa politique de « best execution », parmi les établissements ayant leur siège social dans un pays membre de l'OCDE ou de l'Union européenne mentionnés au R.214-19 du Code monétaire et financier, ayant une notation émetteur de bonne qualité. Ces contreparties peuvent être des sociétés liées à la société de gestion.

Le calcul du risque global du compartiment se fait selon la méthode de calcul de l'engagement.

Stratégie d'investissement se rapportant au FCP

Pour limiter l'impact des coûts de transaction en cas de demandes de souscription et de rachat de petite taille et pour suivre de plus près la stratégie d'investissement du compartiment maître, le FCP nourricier peut avoir recours à titre accessoire, à des instruments dérivés tels que :

- des futures sur actions / indices boursiers,
- des options sur actions, indices boursiers,

L'ensemble de ces derniers instruments est utilisé pour ajuster le risque action.

- **Titres intégrant des dérivés :**

Le Compartiment n'a pas vocation à acquérir ce type d'actifs directement. Les éventuels bons de souscription détenus en portefeuille le seront uniquement à la suite d'opérations sur titres entraînant l'attribution de ce type de titres.

- **Dépôts :**

Le Compartiment peut procéder à des opérations de dépôts d'une durée maximum de 12 mois, auprès d'un ou plusieurs établissements de crédit et dans la limite de 100% de l'actif net.

- **Emprunts d'espèces :**

Dans le cadre de son fonctionnement normal, le Compartiment peut se trouver ponctuellement en position débitrice et avoir recours dans ce cas à l'emprunt d'espèces, dans la limite de 10% de son actif net.

- **Opérations d'acquisition et de cession temporaire de titres :**

Néant.

- **Informations relatives aux contrats constituant des garanties financières :**

Le Compartiment peut, pour la réalisation de son objectif de gestion, recevoir ou octroyer les garanties mentionnées à l'article L. 211-38 du code monétaire et financier conformément à la politique de risques de la société de gestion. Ces garanties peuvent ainsi être des espèces, des instruments du marché monétaire, des obligations émises ou garanties par un membre de l'OCDE, des actions, des parts d'OPCVM à liquidité quotidienne, etc. et sont conservées dans des comptes ségrégués par le dépositaire.

Ces garanties feront l'objet de décote adaptée à chaque catégorie d'actifs conformément à la politique de risques de la société de gestion. Seules les garanties reçues en espèce peuvent être réinvesties conformément à la réglementation en vigueur conformément à la position AMF n°2013-06. Ainsi les espèces reçues peuvent être placées en dépôt, investies dans des obligations d'Etat de haute qualité, utilisées dans le cadre d'opérations de prises en pension, investies dans des OPCVM monétaires court terme.

Les garanties financières reçues doivent être suffisamment diversifiées. Les titres reçus d'un même émetteur ne peuvent pas dépasser 20% de l'actif net. Par dérogation, le Compartiment peut recevoir en garantie, jusqu'à 100% de son actif net, des titres émis ou garantis par un Etat membre de l'OCDE conformément à la politique de risques de la société de gestion. Ainsi, le Compartiment peut être pleinement garanti par des titres émis ou garantis par un seul Etat membre de l'OCDE éligible.

Outre les garanties visées ci-dessus, la SICAV constitue une garantie financière sur ses actifs (titres financiers et espèces) au bénéfice du dépositaire au titre de ses obligations financières à l'égard de celui-ci.

RESUME DES REGLES DE CONDUITE INTERNES APPLICABLES AU FCP NOURRICIER :

Conformément à la réglementation actuellement applicable relative à la mise en place des structures maître et nourricier, la société de gestion du FCP nourricier et du compartiment maître a mis en place des règles de conduite internes en date du 1er novembre 2017.

Les dispositions contenues dans cet accord rappellent, en particulier, les modalités d'accès et d'échange d'informations entre le FCP nourricier et le compartiment maître, les principes et conditions de souscription et de rachat de la part du FCP nourricier, ainsi que les règles de publication de la valeur liquidative de la part qui sont de nature à assurer un bon fonctionnement des opérations pouvant avoir lieu entre les deux OPC. Le droit applicable est le droit français.

L'attention du souscripteur est attirée sur le fait que les informations mentionnées au paragraphe précédent, ne constituent qu'un résumé général de l'accord, conclu entre le FCP nourricier et le compartiment maître tous deux de droit français.

PROFIL DE RISQUE :

BNP PARIBAS INDICE EURO est un FCP classé « Actions des pays de la zone euro ». En raison de son investissement en totalité dans la catégorie d'actions « EUR C/D » du compartiment « BNP PARIBAS EASY EURO STOXX® 50 UCITS ETF », l'investisseur est principalement exposé aux risques directs et indirects indiqués ci-dessous.

Le profil de risque du FCP est identique au profil de risque du compartiment maître.

Le profil de risque du Compartiment est adapté à un horizon d'investissement supérieur ou égal à 5 ans. Comme tout investissement financier, les investisseurs potentiels doivent être conscients que la valeur des actifs du compartiment est soumise aux fluctuations des actifs rentrant dans la composition de l'indicateur de référence et qu'elle peut varier fortement.

Le Compartiment est un OPCVM classé « Actions de pays de la zone euro ». L'investisseur est donc exposé aux risques suivants :

- Risque de marché :

L'actionnaire est pleinement exposé à l'indice EURO STOXX® 50Net Return.

Une évolution à la baisse des actions composant l'indice EURO STOXX® 50Net Return provoque une baisse de la valeur liquidative du compartiment.

- Risque de perte en capital :

L'investisseur est averti que la performance du Compartiment peut ne pas être conforme à ses objectifs et que son capital investi (déduction faite des commissions de souscription) peut ne pas lui être totalement restitué.

- Risque de contrepartie :

Le Compartiment est exposé à un risque de contrepartie compte tenu de la conclusion d'instruments financiers à terme de gré à gré en vue de réaliser l'objectif de gestion. Le risque de contrepartie s'entend comme les pertes encourues par le Compartiment au titre de ses engagements vis-à-vis d'une autre contrepartie en cas de défaillance de cette dernière. Néanmoins, le risque de contrepartie est limité par la mise en place de garantie accordée au Compartiment conformément à la réglementation en vigueur.

- Risque de crédit :

Il est lié à la capacité d'un émetteur à honorer ses dettes et au risque de dégradation de la notation d'une émission ou d'un émetteur qui pourrait entraîner la baisse de la valeur des titres de créance dans lesquels le Compartiment est investi. Ce risque est également lié à l'utilisation de dérivés de crédit.

Les investissements effectués en ayant recours aux instruments dérivés de crédit, dans une situation de marché présentant une faible liquidité, pourraient entraîner des moins-values significatives en cas de nécessité de vente de ces actifs. Dans ce cas, la valeur liquidative du Compartiment pourrait baisser.

- Risque de liquidité :

La liquidité d'un marché se manifestant notamment sous la forme d'une fourchette de prix large, l'actionnaire supporte un risque de perte dû aux ajustements des instruments financiers à terme détenus par le

compartiment dans des situations de marchés illiquides. Par conséquent dans de telles situations, le coût lié aux ajustements des instruments détenus par le compartiment en cas de souscriptions ou de rachats peut s'avérer particulièrement important et est répercuté sur la valeur liquidative du compartiment.

- Risque de liquidité sur une place de cotation :

Le cours de bourse de l'ETF est susceptible de s'écarter de sa valeur liquidative indicative. La liquidité des actions du Compartiment sur une place de cotation peut être affectée par toute suspension qui pourrait être due, notamment à :

- une suspension ou l'arrêt du calcul de l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return ;
- une suspension du (des) marché(s) où sont cotés les composants de l'indice EURO STOXX[®] 50 Net Return ;
- L'impossibilité pour une place de cotation considérée d'obtenir ou de calculer la valeur liquidative indicative du Compartiment ;
- une infraction par un teneur de marché aux règles applicables sur cette place ;
- une défaillance dans les systèmes notamment informatiques ou électroniques de cette place.

- Risque lié à l'emploi des dérivés :

Dans le but de réaliser son objectif de gestion, le Compartiment peut utiliser des produits dérivés de gré à gré ou listés, pour couvrir et/ou optimiser le rendement de son portefeuille. L'attention des investisseurs est attirée sur le fait que par ce biais, la volatilité du rendement du Compartiment est accrue et que l'utilisation de ces instruments peut modifier de manière importante l'exposition du portefeuille par rapport à un simple investissement en direct. La survenance de ce risque pourrait faire baisser la valeur liquidative du Compartiment.

- Risque de conflit d'intérêts et risque lié à la conclusion de contrats avec des contreparties liées :

La société de gestion peut être conduite à conclure des contrats financiers avec des contreparties liées au groupe auquel appartient la société de gestion. Dans ce cas, il existe un conflit d'intérêt potentiel entre les intérêts des clients et les intérêts du groupe auquel appartient la société de gestion. Le maintien d'une politique efficace de gestion des conflits d'intérêts par la société de gestion permet dans ce cas d'assurer le respect de la primauté de l'intérêt de ses clients.

- Risques liés à la gestion des garanties :

La gestion des garanties reçues dans le cadre des contrats d'échange sur rendement global peut comporter certains risques spécifiques tels que des risques opérationnels ou le risque de conservation. Ainsi la conclusion de ces contrats peut entraîner un effet négatif sur la valeur liquidative du Compartiment.

- Risque juridique :

L'utilisation des contrats d'échange sur rendement global (TRS) peut entraîner un risque juridique lié notamment à l'exécution des contrats.

SOUSCRIPTEURS CONCERNES ET PROFIL DE L'INVESTISSEUR TYPE :

Catégories de parts « Classic » de classe « C » et de classe « D » : Tous souscripteurs. Destinée principalement aux personnes physiques.

Catégories de parts « Privilege » de classe « C » et de classe « D » : Réservée aux souscripteurs conseillés par des conseils indépendants au sens de MIF 2 (1) et à la gestion sous mandat (GSM).

(1) Distributeurs de pays membres de l'Espace Economique Européen fournissant uniquement un service de conseil indépendant au sens de la Directive MIF 2004/39.

Le FCP peut servir d'unité de compte aux contrats d'assurance vie et de capitalisation. Ce FCP s'adresse à des investisseurs qui souhaitent s'exposer aux marchés actions européens.

Le montant qu'il est raisonnable d'investir dans ce FCP dépend de votre situation personnelle. Pour le déterminer, vous devez tenir compte de votre patrimoine personnel, de vos besoins actuels et à horizon de 5 ans, mais également de votre souhait de prendre des risques ou au contraire, de privilégier un investissement prudent. Il est également fortement recommandé de diversifier suffisamment vos investissements afin de ne pas les exposer uniquement aux risques de ce FCP.

INFORMATIONS RELATIVES AUX INVESTISSEURS AMERICAINS :

La société de gestion n'est pas enregistrée en qualité d'*investment adviser* aux Etats-Unis.

Le FCP n'est pas enregistré en tant que véhicule d'investissement aux Etats-Unis et ses parts ne sont pas et ne seront pas enregistrées au sens du *Securities Act* de 1933 et, ainsi, elles ne peuvent pas être proposées ou vendues à des *Restricted Persons*, telles que définies ci-après.

Les *Restricted Persons* correspondent à (i) toute personne ou entité située sur le territoire des Etats-Unis (y compris les résidents américains), (ii) toute société ou toute autre entité relevant de la législation des Etats-Unis ou de l'un de ses Etats, (iii) tout personnel militaire des Etats-Unis ou tout personnel lié à un département ou une agence du gouvernement américain situé en dehors du territoire des Etats-Unis, ou (iv) toute autre personne qui serait considérée comme une U.S. Person au sens de la Regulation S issue du *Securities Act* de 1933, tel que modifié.

Par ailleurs, les parts du FCP ne peuvent pas être proposées ou vendues à des régimes d'avantages sociaux des employés ou à des entités dont les actifs constituent des actifs de régimes d'avantages sociaux des employés qu'ils soient ou non soumis aux dispositions du *United States Employee Retirement Income Securities Act* de 1974, tel qu'amendé.

FATCA :

En application des dispositions du *Foreign Account Tax Compliance Act* (« FATCA ») applicables à compter du 1er juillet 2014, dès lors que le FCP investit directement ou indirectement dans des actifs américains, les revenus tirés de ces investissements sont susceptibles d'être soumis à une retenue à la source de 30%.

Afin d'éviter le paiement de la retenue à la source de 30%, la France et les Etats-Unis ont conclu un accord intergouvernemental aux termes duquel les institutions financières non américaines (« foreign financial institutions ») s'engagent à mettre en place une procédure d'identification des investisseurs directs ou indirects ayant la qualité de contribuables américains et à transmettre certaines informations sur ces investisseurs à l'administration fiscale française, laquelle les communiquera à l'autorité fiscale américaine (« Internal Revenue Service »).

Le FCP, en sa qualité de *foreign financial institution*, s'engage à se conformer à FATCA et à prendre toute mesure relevant de l'accord intergouvernemental précité.

INDICATIONS RELATIVES A L'ECHANGE AUTOMATIQUE D'INFORMATIONS

Pour répondre aux exigences de l'Echange Automatique d'Informations (Automatic Exchange of Information - AEOI), la société de gestion peut avoir l'obligation de recueillir et de divulguer des informations sur les porteurs du FCP à des tiers, y compris aux autorités fiscales, afin de les transmettre aux juridictions concernées. Ces informations peuvent inclure (mais ne sont pas limitées à) l'identité des porteurs et de leurs bénéficiaires directs ou indirects, des bénéficiaires finaux et des personnes les contrôlant. Le porteur est tenu de se conformer à toute demande de la société de gestion de fournir ces informations afin de permettre à la société de gestion de se conformer à ses obligations de déclarations.

Pour toute information relative à sa situation particulière, le porteur est invité à consulter un conseiller fiscal indépendant.

DUREE MINIMUM DE PLACEMENT RECOMMANDEE : Cinq ans

MODALITES DE DETERMINATION ET D'AFFECTION DES RESULTATS :

Pour les Catégories de parts « Classic » de classe « D » et « Privilege » de classe « D » :

- Affectation du résultat net : distribution. La société de gestion a opté pour la distribution. Le résultat net est intégralement distribué chaque année. La société de gestion peut décider de distribuer des acomptes.
- Affectation des plus-values nettes réalisées : capitalisation. La société de gestion a opté pour la capitalisation. Les plus-values nettes réalisées sont intégralement capitalisées chaque année.

Pour les Catégories de parts « Classic » de classe « C » et « Privilege » de classe « C » :

- Affectation du résultat net : capitalisation. La société de gestion a opté pour la capitalisation. Le résultat net est intégralement capitalisé chaque année.
- Affectation des plus-values nettes réalisées : capitalisation. La société de gestion a opté pour la capitalisation. Les plus-values nettes réalisées sont intégralement capitalisées chaque année.

Comptabilisation des intérêts selon la méthode des intérêts encaissés.

FREQUENCE DE DISTRIBUTION : Annuelle pour la Catégorie de part « Classic » de classe « D ».

CARACTERISTIQUES DES PARTS :

TABLEAU RECAPITULATIF DES PRINCIPALES CARACTERISTIQUES DES PARTS

Catégories de parts	Codes ISIN	Affectation des sommes distribuables	Devise de libellé	Souscripteurs concernés	Fractionnement des parts	Montant minimum des souscriptions
Catégorie de part « Classic » de classe « D »	FR0010536144	Résultat net : Distribution Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Tous souscripteurs Principalement personnes physiques.	Millième de part	Un millième de part
Catégorie de part « Classic » de classe « C »	FR0011538230	Résultat net : Capitalisation Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Tous souscripteurs Principalement personnes physiques.	Millième de part	Un millième de part
Catégorie de part « Privilège » de classe « D »	FR0013276193	Résultat net : Distribution Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Réservée aux souscripteurs conseillés par des conseils indépendants au sens de MIF 2 (1) et à la gestion sous mandat (GSM)	Millième de part	Un millième de part
Catégorie de part « Privilège » de classe « C »	FR0013276185	Résultat net : Capitalisation Plus-values nettes réalisées : Capitalisation	EUR	Réservée aux souscripteurs conseillés par des conseils indépendants au sens de MIF 2 (1) et à la gestion sous mandat (GSM)	Millième de part	Un millième de part

(1) Distributeurs de pays membres de l'Espace Economique Européen fournissant uniquement un service de conseil indépendant au sens de la Directive MIF 2004/39.

MODALITES DE SOUSCRIPTION ET DE RACHAT :

Les ordres sont exécutés conformément au tableau ci-dessous :

J : Jour d'établissement de la VL			J+1 ouvré	J+5 ouvrés maximum	J+5 ouvrés maximum
Centralisation avant 13h des ordres de souscription (1)	Centralisation avant 13h des ordres de rachat (1)	Exécution de l'ordre au plus tard en J	Publication de la valeur liquidative	Règlement des souscriptions	Règlement des rachats

(1) Sauf éventuel délai spécifique convenu avec votre établissement financier.

Les demandes de souscription et de rachat peuvent porter sur un nombre entier de parts ou sur une fraction de part, chaque part étant divisée en millième.

Les demandes reçues le samedi sont centralisées le premier jour ouvré suivant.

MONTANT MINIMUM DES SOUSCRIPTIONS :

Souscription initiale :

Catégorie de part « Classic » de classe « D » : un millième de part.

Catégorie de part « Classic » de classe « C » : un millième de part.

Catégories de parts « Privilege » de classe « C » et « D » : un millième de part.

(1) Distributeurs de pays membres de l'Espace Economique Européen fournissant uniquement un service de conseil indépendant au sens de la Directive MIF 2004/39.

Souscription ultérieure :

Catégorie de part « Classic » de classe « D » : un millième de part.

Catégorie de part « Classic » de classe « C » : un millième de part.

Catégorie de part « Privilege » de classe « D » : un millième de part.

Catégorie de part « Privilege » de classe « C » : un millième de part.

ORGANISME ASSURANT LA RECEPTION DES ORDRES DE SOUSCRIPTION ET DE RACHAT PAR DELEGATION : BNP Paribas.

VALEUR LIQUIDATIVE D'ORIGINE :

Catégorie de part « Classic » de classe « D » : 200 euros (parts créées le 24/10/2007).

Catégorie de part « Classic » de classe « C » : 132,17 euros

Catégorie de part « Privilege » de classe « D » : la valeur liquidative est celle de la part « Classic » de classe « D » au jour de la création.

Catégorie de part « Privilege » de classe « C » : la valeur liquidative est celle de la part « Classic » de classe « C » au jour de la création.

DATE ET PERIODICITE DE CALCUL DE LA VALEUR LIQUIDATIVE :

Quotidienne, à l'exception des samedis, dimanches, des jours fériés légaux en France, des jours de fermeture des Marchés français (calendrier officiel d'Euronext) et des jours de non-diffusion de l'indice Euro Stoxx 50.

Dispositif de plafonnement des rachats (« Gates ») :

Conformément au règlement du FCP, la société de gestion peut décider d'étaler les demandes de rachats des porteurs sur plusieurs valeurs liquidatives dès lors qu'elles excèdent un seuil déterminé, lorsque des circonstances exceptionnelles l'exigent et si l'intérêt des porteurs ou du public le commande.

(i) Description de la méthode

La société de gestion a la faculté de ne pas exécuter en totalité les ordres de rachat centralisés sur une même valeur liquidative si la somme des demandes de rachats nets sur cette valeur liquidative excède 5% de l'actif net du FCP. Dans cette hypothèse, la société de gestion peut décider d'exécuter les rachats dans la limite de 5% de l'actif net du FCP (ou un pourcentage supérieur à la discrétion de la société de gestion) au prorata de chaque demande. Le seuil de 5% est déterminé sur la base du dernier actif net connu du FCP.

(ii) Modalités d'information des porteurs

En cas de déclenchement du dispositif de plafonnement des rachats, les porteurs du FCP seront informés par tout moyen via le site internet www.bnpparibas-am.com.

Les porteurs du FCP dont les demandes de rachat n'ont pas été entièrement exécutées seront informés, de manière particulière, dans les meilleurs délais après la date de centralisation des ordres de rachats par le centralisateur des ordres de souscription et de rachat.

(iii) Traitement des ordres non exécutés

En cas de déclenchement du dispositif de plafonnement des rachats, les demandes de rachat seront réduites proportionnellement pour tous les porteurs du FCP. Les demandes de rachat en attente d'exécution

seront reportées automatiquement sur la prochaine date de centralisation des ordres de rachats. Les ordres reportés n'auront pas rang de priorité sur des demandes de rachat ultérieures.

Les porteurs du FCP n'ont pas la possibilité de s'opposer formellement au report de la partie non exécutée de leur ordre de rachat ni de demander l'annulation de la partie non exécutée de l'ordre de rachat dans le respect du préavis de centralisation du FCP.

Si, pour un jour de centralisation des ordres de rachats donné, les demandes nettes de rachats des parts du FCP représentent 15% de l'actif net du FCP, alors que le seuil de déclenchement des gates est fixé à 5% de l'actif net du FCP, la société de gestion pourra décider, par exemple, d'honorer les demandes de rachats jusqu'à 10% de l'actif net du FCP. Ainsi, 66,66% des demandes de rachats seraient exécutées au lieu de 33,33% si la société de gestion appliquait strictement le seuil de 5%.

Le mécanisme d'échelonnement des rachats ne peut être déclenché plus de vingt fois sur une période de trois mois et ne peut durer plus d'un mois. Au-delà, la société de gestion mettra automatiquement fin au mécanisme d'échelonnement des rachats et envisagera une autre solution exceptionnelle (telle que la suspension des rachats par exemple) si la situation l'exige.

(iv) Cas d'exonération

Les opérations de souscription et de rachat, pour un même nombre de parts, sur la base de la même valeur liquidative et pour un même porteur ou ayant droit économique (opérations d'aller-retour) ne sont pas soumises au dispositif de plafonnement des rachats.

COMMISSIONS ET FRAIS :

COMMISSIONS DE SOUSCRIPTION ET DE RACHAT :

Définition générale : les commissions de souscription et de rachat viennent augmenter le prix de souscription payé par l'investisseur ou diminuer le prix de remboursement. Les commissions acquises au FCP servent à compenser les frais supportés par le FCP pour investir ou désinvestir les avoirs confiés. Les commissions non acquises reviennent à la société de gestion, au commercialisateur, etc.

Commissions de souscription et de rachat du FCP Nourricier BNP PARIBAS INDICE EURO :

FRAIS A LA CHARGE DE L'INVESTISSEUR PRELEVEES LORS DES SOUSCRIPTIONS ET DES RACHATS	ASSIETTE	TAUX / BAREME
COMMISSION DE SOUSCRIPTION NON ACQUISE AU FCP	Valeur liquidative X nombre de parts	Catégories de parts « Classic » et « Privilege » : 2 % maximum <u>Cas d'exonération</u> : souscriptions par les OPCVM ou les FIA gérés par les sociétés de gestion du groupe BNP Paribas
COMMISSION DE SOUSCRIPTION ACQUISE AU FCP	/	Néant
COMMISSION DE RACHAT NON ACQUISE AU FCP	/	Néant
COMMISSION DE RACHAT ACQUISE AU FCP	/	Néant

Commissions de souscription et de rachat du compartiment maître
BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF :

MARCHE PRIMAIRE

FRAIS A LA CHARGE DE L'INVESTISSEUR, PRELEVES LORS DES SOUSCRIPTIONS ET DES RACHATS	ASSIETTE	TAUX / BAREME DU COMPARTIMENT
COMMISSION DE SOUSCRIPTION MAXIMUM NON ACQUISE AU COMPARTIMENT	Valeur liquidative × nombre d'actions	Pour les souscriptions en numéraire : 3% maximum Pour les souscriptions par apport d'instruments financiers : 10.000 euros maximum
COMMISSION DE SOUSCRIPTION ACQUISE AU COMPARTIMENT	Valeur liquidative × nombre d'actions	Modalités particulières(1)(2)
COMMISSION DE RACHAT NON ACQUISE AU COMPARTIMENT	Valeur liquidative × nombre d'actions	Pour les rachats en numéraire : 3% maximum Pour les rachats en instruments financiers : 10.000 euros maximum
COMMISSION DE RACHAT ACQUISE AU COMPARTIMENT	Valeur liquidative × nombre d'actions	Modalités particulières(1)(3)

Modalités particulières :

- (1) La société de gestion met en oeuvre quotidiennement une politique de droits ajustables afin de faire supporter les coûts d'ajustement du portefeuille aux intervenants du marché primaire lorsque ceux-ci placent un ordre en espèces. La méthodologie de calcul des droits ajustables utilisée par la société de gestion est décrite dans une procédure établie et mise en place par la société de gestion ;
- (2) Pour toute opération de souscription réalisée par les intervenants du marché primaire, les commissions sont égales aux coûts théoriques supportés par le Compartiment pour investir les sommes résultant de la souscription en tenant compte des modalités d'exécution convenues avec les intervenants du marché primaire. Les coûts théoriques sont définis comme étant les frais de transaction en relation avec l'opération de souscription, les droits de timbre, impôts et taxes, les frais bancaires, les frais de change, les intérêts, les frais de garde, les frais de transfert, les frais d'enregistrement et autres droits et charges applicables ;
- (3) Pour toute opération de rachat réalisée par les intervenants du marché primaire, les commissions sont égales aux coûts théoriques supportés par le Compartiment pour désinvestir les sommes résultant du rachat en tenant compte des modalités d'exécution convenues avec les intervenants du marché primaire. Les coûts théoriques sont définis comme étant les frais de transaction en relation avec l'opération ou de rachat, les droits de timbre, impôts et taxes, les frais bancaires, les frais de change, les intérêts, les frais de garde, les frais de transfert, les frais d'enregistrement et autres droits et charges applicables.

MARCHE SECONDAIRE

Ni l'achat ni la vente en Bourse des actions du Compartiment ne donnera lieu à versement de commissions de souscription ou de rachat. Toutefois, d'autres frais, tels que des frais de bourse et / ou d'intermédiation peuvent être prélevés par les intermédiaires financiers.

Frais facturés au FCP :

Ces frais recouvrent les frais de gestion financière, les frais de gestion administratifs externes à la société de gestion et les frais indirects maximums (commissions et frais de gestion).

Une partie des frais facturés au FCP peut également être destinée à rémunérer le(s) distributeur(s) du FCP au titre de son (leur) activité de conseil et de placement (entre 28% et 65% selon le(s) distributeur(s) et le type de parts).

Aux frais facturés peuvent s'ajouter :

- des commissions de surperformance. Celles-ci rémunèrent la société de gestion dès lors que le FCP a dépassé son objectif de performance.
- des commissions de mouvement facturées au FCP

Frais facturés au FCP Nourricier BNP PARIBAS INDICE EURO :

FRAIS FACTURES AU FCP	ASSIETTE	TAUX / BAREME DU FCP
FRAIS DE GESTION FINANCIERE	Actif net	Catégories de parts « Classic » : 0,70% TTC maximum Catégories de parts « Privilege » : 0,35% TTC maximum
FRAIS ADMINISTRATIFS EXTERNES A LA SOCIETE DE GESTION	Actif net	Catégories de parts « Classic » : 0,10% TTC maximum Catégories de parts « Privilege » : 0,10% TTC maximum
COMMISSION DE SURPERFORMANCE	/	Néant

Frais facturés au compartiment maître BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF :

FRAIS FACTURÉS AU COMPARTIMENT	ASSIETTE	TAUX / BAREME
FRAIS DE GESTION FINANCIERE TTC	Actif net	0,06% par an maximum
FRAIS ADMINISTRATIFS EXTERNES A LA SOCIETE DE GESTION TTC	Actif net	0,12% par an maximum
FRAIS INDIRECTS MAXIMUM	Actif net	Néant
COMMISSIONS DE MOUVEMENT	Prélèvement sur chaque transaction	Néant
COMMISSION DE SURPERFORMANCE	Actif net	Néant

INFORMATIONS COMPLEMENTAIRES CONCERNANT LES OPERATIONS D'ACQUISITION ET DE CESSIION TEMPORAIRE DE TITRES :

Néant.

DESCRIPTION SUCCINCTE DE LA PROCEDURE DE CHOIX DES INTERMEDIAIRES :

Le suivi de la relation entre BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe et les intermédiaires financiers fait l'objet d'un ensemble formalisé de procédures, organisé par une équipe dédiée rapportant au Chief Investment Officer et au responsable du Risk Management.

Toute entrée en relation fait l'objet d'une procédure d'agrément afin de minimiser le risque de défaillance lors des transactions sur les instruments financiers négociés sur les marchés réglementés ou organisés (instruments monétaires, obligataires et dérivés taux, actions en vif et dérivés actions).

Les critères retenus dans le cadre de cette procédure de sélection des contreparties sont les suivants : la capacité à offrir des coûts d'intermédiation compétitifs, la qualité de l'exécution des ordres, la pertinence des prestations de recherche accordées aux utilisateurs, leur disponibilité pour discuter et argumenter leurs diagnostics, leur capacité à offrir une gamme de produits et de services (qu'elle soit large ou spécialisée) correspondant aux besoins de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, leur capacité à optimiser le traitement administratif des opérations.

Le poids accordé à chaque critère dépend de la nature du processus d'investissement concerné.

III. INFORMATIONS D'ORDRE COMMERCIAL

III.1 - MODALITES DE SOUSCRIPTION ET DE RACHAT DES PARTS

Dans le cadre des dispositions du prospectus, les souscriptions et les rachats de parts du FCP peuvent être effectués auprès des agences de BNP Paribas et le cas échéant auprès des intermédiaires financiers affiliés à Euroclear France.

III.2 - MODALITES D'INFORMATION DES PORTEURS

COMMUNICATION DU PROSPECTUS, DES DOCUMENTS D'INFORMATIONS CLES, DES DERNIERS DOCUMENTS ANNUEL ET PERIODIQUE :

Le prospectus, les documents d'informations clés ainsi que les derniers documents annuel et périodique sont adressés dans un délai de huit jours ouvrés sur simple demande écrite du porteur auprès de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX.

Ces documents sont également disponibles sur le site Internet « www.bnpparibas-am.com ».

Le document "politique de vote", ainsi que le rapport rendant compte des conditions dans lesquelles les droits de vote ont été exercés, sont consultables à l'adresse ci-dessous :

Service Marketing & Communication - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX

Ou sur le site Internet www.bnpparibas-am.com.

L'absence de réponse à une demande d'information relative au vote portant sur une résolution, à l'issue d'un délai d'un mois, doit être interprétée comme indiquant que la société de gestion a voté conformément aux principes posés dans le document "politique de vote" et aux propositions de ses organes dirigeants.

Des explications supplémentaires peuvent être obtenues si nécessaire auprès des agences BNP Paribas.

MODALITES DE COMMUNICATION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE :

La valeur liquidative peut être consultée dans les agences de BNP Paribas et sur le site Internet « www.bnpparibas-am.com ».

La valeur liquidative du compartiment maître peut être consultée sur le site Internet www.bnpparibas-ip.com.

MISE A DISPOSITION DE LA DOCUMENTATION COMMERCIALE DU FCP :

La documentation commerciale du FCP est mise à disposition des porteurs dans les agences du Groupe BNP Paribas et sur le site Internet « www.bnpparibas-am.com ».

INFORMATION EN CAS DE MODIFICATION DES MODALITES DE FONCTIONNEMENT DU FCP :

Les porteurs sont informés des modifications apportées aux modalités de fonctionnement du FCP, soit individuellement, soit par voie de presse soit par tout autre moyen conformément à l'instruction n°2011-19. Cette information peut être effectuée, le cas échéant, par l'intermédiaire d'Euroclear France et des intermédiaires financiers qui lui sont affiliés.

TRANSMISSION DE LA COMPOSITION DU PORTEFEUILLE AUX INVESTISSEURS SOUMIS AUX EXIGENCES DE LA DIRECTIVE 2009/138/CE (« DIRECTIVE SOLVABILITE 2 ») :

Dans les conditions prévues par la position AMF 2004-07, la société de gestion peut communiquer la composition du portefeuille du FCP aux porteurs soumis aux exigences de la Directive Solvabilité 2, à l'échéance d'un délai minimum de 48h après publication de la valeur liquidative du FCP.

POLITIQUE APPLICABLE EN MATIERE D'ACTION DE GROUPE (« CLASS ACTION ») :

Conformément à sa politique, la société de gestion :

- ne participe pas, en principe, à des *class actions* actives (à savoir, la société de gestion n'engage aucune procédure, n'agit pas en qualité de plaignant, ne joue aucun rôle actif dans une *class action* contre un émetteur) ;
- peut participer à des *class actions* passives dans les juridictions où la société de gestion estime, à sa seule discrétion, que (i) la *class action* est suffisamment rentable (par exemple, lorsque les revenus attendus dépassent les coûts à prévoir pour la procédure), (ii) l'issue de la *class action*

est suffisamment prévisible et (iii) les données pertinentes requises pour l'évaluation de l'éligibilité de la *class action* sont raisonnablement disponibles et peuvent être gérées de manière efficace et suffisamment fiable ;

- reverse toutes les sommes perçues par la société de gestion dans le cadre d'une *class action*, nettes des coûts externes supportés, aux fonds impliqués dans la *class action* concernée.

La société de gestion peut à tout moment modifier sa politique applicable en matière de *class actions* et peut s'écarter des principes énoncés ci-dessus dans des circonstances particulières.

Les principes de la politique en matière de *class actions* applicable au FCP sont disponibles sur le site internet de la société de gestion.

INFORMATION RELATIVE A LA DEMARCHE D'INVESTISSEMENT DURABLE :

Des informations et documents sur l'approche de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT en matière d'investissement durable sont disponibles sur le site internet à l'adresse suivante : <https://www.bnpparibas-am.com/fr/sustainability>.

INFORMATIONS DISPONIBLES AUPRES DE L'AUTORITE DES MARCHES FINANCIERS :

Le site Internet de l'AMF « www.amf-france.org » contient des informations complémentaires sur la liste des documents réglementaires et l'ensemble des dispositions relatives à la protection des investisseurs.

IV. REGLES D'INVESTISSEMENT

Les règles d'investissement, ratios réglementaires et dispositions transitoires applicables, en l'état actuel de la réglementation découlent du code monétaire et financier.

Les principaux instruments financiers et techniques de gestion utilisés par le FCP sont mentionnés dans le chapitre II.2 « dispositions particulières » du prospectus.

V. RISQUE GLOBAL

Le risque global du FCP est calculé selon la méthode de calcul de l'engagement.

VI. REGLES D'EVALUATION ET METHODE DE COMPTABILISATION DES ACTIFS

VI.1 - REGLES D'EVALUATION DES ACTIFS

La valeur liquidative du FCP nourricier est calculée en fonction de celle de son compartiment maître à cours connu.

Le FCP étant nourricier du compartiment « BNP PARIBAS EASY EURO STOXX 50 UCITS ETF », catégorie d'action « EUR C/D » de la SICAV BNP PARIBAS EASY FR, il peut en conséquence :

- employer jusqu'à 100% de son actif net en parts de cet OPCVM,
- détenir jusqu'à 100% des parts émises par celui-ci,
- investir à titre accessoire en dépôt (liquidités), dans la stricte limite des besoins liés à la gestion de ses flux.

VI.2 - METHODE DE COMPTABILISATION

Les intérêts sont comptabilisés selon la méthode des intérêts encaissés.

VII. REMUNERATION

La politique de rémunération de la société de gestion a été conçue pour protéger les intérêts des clients, éviter les conflits d'intérêts et garantir qu'il n'y a pas d'incitation à une prise de risque excessive.

Elle met en œuvre les principes suivants : payer pour la performance, partager la création de richesse, aligner à long terme les intérêts des collaborateurs et de l'entreprise et promouvoir un élément d'association financière des collaborateurs aux risques.

Les détails de la politique de rémunération actualisée, comprenant notamment les personnes responsables de l'attribution des rémunérations et des avantages et une description de la manière dont ils sont calculés, sont disponibles sur le site internet <http://www.bnpparibas-am.com/fr/politique-de-remuneration/>. Un exemplaire sur papier est également mis à disposition gratuitement sur simple demande écrite auprès de la société de gestion.

DATE DE PUBLICATION DU PROSPECTUS : 1^{er} mars 2024

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe

1, boulevard Haussmann
75009 PARIS

319 378 832 R.C.S. PARIS

REGLEMENT DU FONDS COMMUN DE PLACEMENT

BNP PARIBAS INDICE EURO

TITRE I

ACTIF ET PARTS

ARTICLE 1 - Parts de copropriété

Les droits des copropriétaires sont exprimés en parts, chaque part correspondant à une même fraction de l'actif du FCP ou, le cas échéant, du compartiment. Chaque porteur de part dispose d'un droit de copropriété sur les actifs du FCP proportionnel au nombre de parts possédées.

La durée du FCP est de 99 ans à compter de sa constitution sauf dans les cas de dissolution anticipée ou de la prorogation prévue au présent règlement.

Dans le cas où le FCP est un FCP à compartiment, chaque compartiment émet des parts en représentation des actifs du FCP qui lui sont attribués. Dans ce cas, les dispositions du présent règlement applicables aux parts du FCP sont applicables aux parts émises en représentation des actifs du compartiment.

Le FCP peut émettre différentes catégories de parts dont les caractéristiques et les conditions d'accès sont précisées dans le prospectus du FCP.

Les différentes catégories de parts pourront :

- bénéficier de régimes différents d'affectation des sommes distribuables ;
- être libellées en devises différentes ;
- supporter des frais de gestion différents ;
- supporter des commissions de souscriptions et de rachat différentes ;
- avoir une valeur nominale différente ;
- être assorties d'une couverture systématique de risque, partielle ou totale, définie dans le prospectus. Cette couverture est assurée au moyen d'instruments financiers réduisant au minimum l'impact des opérations de couverture sur les autres catégories de parts du FCP ;
- être réservées à un ou plusieurs réseaux de commercialisation.

Les parts pourront être fractionnées, sur décision de l'organe de gouvernance de la société de gestion ou de son Président, en dixièmes, centièmes, millièmes ou dix-millièmes dénommées fractions de parts.

Les dispositions du règlement réglant l'émission et le rachat de parts sont applicables aux fractions de parts dont la valeur sera toujours proportionnelle à celle de la part qu'elles représentent. Toutes les autres dispositions du règlement relatives aux parts s'appliquent aux fractions de parts sans qu'il soit nécessaire de le spécifier, sauf lorsqu'il en est disposé autrement.

L'organe de gouvernance de la société de gestion ou son Président peut, sur ses seules décisions, procéder à la division des parts par la création de parts nouvelles qui sont attribuées aux porteurs en échange des parts anciennes. Les parts pourront également être regroupées.

ARTICLE 2 - Montant minimal de l'actif

Il ne peut être procédé au rachat des parts si l'actif du FCP ou, le cas échéant, d'un compartiment devient inférieur au montant fixé par la réglementation ; lorsque l'actif demeure pendant trente jours inférieur à ce montant, la société de gestion prend les dispositions nécessaires afin de procéder à la liquidation du FCP, ou à une des opérations mentionnées à l'article 411-16 du règlement général de l'AMF (mutation du FCP).

ARTICLE 3 - Emission et rachat des parts

Les parts sont émises à tout moment à la demande des porteurs sur la base de leur valeur liquidative augmentée, le cas échéant, des commissions de souscription.

Les rachats et les souscriptions sont effectués dans les conditions et selon les modalités définies dans le prospectus.

Les parts de FCP peuvent faire l'objet d'une admission à la cote selon la réglementation en vigueur.

Les souscriptions doivent être intégralement libérées le jour du calcul de la valeur liquidative. Elles peuvent être effectuées en numéraire et/ou par apport d'instruments financiers. La société de gestion a le droit de refuser les valeurs proposées et, à cet effet, dispose d'un délai de sept jours à partir de leur dépôt pour faire connaître sa décision. En cas d'acceptation, les valeurs apportées sont évaluées selon les règles fixées à l'article 4 et la souscription est réalisée sur la base de la première valeur liquidative suivant l'acceptation des valeurs concernées.

Les rachats peuvent être effectués en numéraire.

Les rachats peuvent également être effectués en nature. Si le rachat en nature correspond à une quote-part représentative des actifs du portefeuille, alors seul l'accord écrit signé du porteur sortant doit être obtenu par l'OPCVM ou la société de gestion. Lorsque le rachat en nature ne correspond pas à une quote-part représentative des actifs du portefeuille, l'ensemble des porteurs doivent signifier leur accord écrit autorisant le porteur sortant à obtenir le rachat de ses parts contre certains actifs particuliers, tels que définis explicitement dans l'accord.

Toutefois, si en cas de circonstances exceptionnelles, le remboursement nécessite la réalisation préalable d'actifs compris dans le FCP, ce délai peut être prolongé, sans pouvoir excéder 30 jours.

De manière générale, les actifs rachetés sont évalués selon les règles fixées à l'article 4 et le rachat en nature est réalisé sur la base de la première valeur liquidative suivant l'acceptation des valeurs concernées. Les rachats sont réglés par le teneur de compte émetteur dans un délai maximum de cinq jours suivant celui de l'évaluation de la part.

Sauf en cas de succession ou de donation-partage, la cession ou le transfert de parts entre porteurs, ou de porteurs à un tiers, est assimilée à un rachat suivi d'une souscription ; s'il s'agit d'un tiers, le montant de la cession ou du transfert doit, le cas échéant, être complété par le bénéficiaire pour atteindre au minimum celui de la souscription minimale exigée par le prospectus.

En application de l'article L. 214-8-7 du code monétaire et financier, le rachat par le FCP de ses parts, comme l'émission de parts nouvelles, peuvent être suspendus, à titre provisoire, par la société de gestion, quand des circonstances exceptionnelles l'exigent et si l'intérêt des porteurs le commande.

Lorsque l'actif net du FCP (ou le cas échéant d'un compartiment) est inférieur au montant fixé par la réglementation, aucun rachat des parts ne peut être effectué (sur le compartiment concerné, le cas échéant).

Des conditions de souscription minimale peuvent exister, selon les modalités prévues dans le prospectus du FCP.

Le FCP peut cesser d'émettre des actions en application du troisième alinéa de l'article L. 214-8-7 du code monétaire et financier, de manière provisoire ou définitive, partiellement ou totalement, dans les situations objectives entraînant la fermeture des souscriptions telles qu'un nombre maximum d'actions émises, un montant maximum d'actif atteint ou l'expiration d'une période de souscription déterminée. Le déclenchement de cet outil fera l'objet d'une information par tout moyen des actionnaires existants relative à son activation, ainsi qu'au seuil et à la situation objective ayant conduit à la décision de fermeture partielle ou totale. Dans le cas d'une fermeture partielle, cette information par tout moyen précisera explicitement les modalités selon lesquelles les actionnaires existants peuvent continuer de souscrire pendant la durée de cette fermeture partielle. Les actionnaires sont également informés par tout moyen de la décision de l'OPCVM ou de la société de gestion soit de mettre fin à la fermeture totale ou partielle des souscriptions (lors du passage sous le seuil de déclenchement), soit de ne pas y mettre fin (en cas de changement de seuil ou de modification de la situation objective ayant conduit à la mise en œuvre de cet outil). Une modification de la situation objective invoquée ou du seuil de déclenchement de l'outil doit toujours être effectuée dans l'intérêt des actionnaires. L'information par tous moyens précise les raisons exactes de ces modifications.

Dispositif de plafonnement des rachats (« Gates ») :

Conformément au règlement du FCP, la société de gestion peut décider d'étaler les demandes de rachats des porteurs sur plusieurs valeurs liquidatives dès lors qu'elles excèdent un seuil déterminé, lorsque des circonstances exceptionnelles l'exigent et si l'intérêt des porteurs ou du public le commande.

(i) Description de la méthode

La société de gestion a la faculté de ne pas exécuter en totalité les ordres de rachat centralisés sur une même valeur liquidative si la somme des demandes de rachats nets sur cette valeur liquidative excède 5% de l'actif net du FCP. Dans cette hypothèse, la société de gestion peut décider d'exécuter les rachats dans la limite de 5% de l'actif net du FCP (ou un pourcentage supérieur à la discrétion de la société de gestion) au prorata de chaque demande. Le seuil de 5% est déterminé sur la base du dernier actif net connu du FCP.

(ii) Modalités d'information des porteurs

En cas de déclenchement du dispositif de plafonnement des rachats, les porteurs du FCP seront informés par tout moyen via le site internet www.bnpparibas-am.com.

Les porteurs du FCP dont les demandes de rachat n'ont pas été entièrement exécutées seront informés, de manière particulière, dans les meilleurs délais après la date de centralisation des ordres de rachats par le centralisateur des ordres de souscription et de rachat.

(iii) Traitement des ordres non exécutés

En cas de déclenchement du dispositif de plafonnement des rachats, les demandes de rachat seront réduites proportionnellement pour tous les porteurs du FCP. Les demandes de rachat en attente d'exécution seront reportées automatiquement sur la prochaine date de centralisation des ordres de rachats. Les ordres reportés n'auront pas rang de priorité sur des demandes de rachat ultérieures.

Les porteurs du FCP n'ont pas la possibilité de s'opposer formellement au report de la partie non exécutée de leur ordre de rachat ni de demander l'annulation de la partie non exécutée de l'ordre de rachat dans le respect du préavis de centralisation du FCP.

Si, pour un jour de centralisation des ordres de rachats donné, les demandes nettes de rachats des parts du FCP représentent 15% de l'actif net du FCP, alors que le seuil de déclenchement des gates est fixé à 5% de l'actif net du FCP, la société de gestion pourra décider, par exemple, d'honorer les demandes de rachats jusqu'à 10% de l'actif net du FCP. Ainsi, 66,66% des demandes de rachats seraient exécutées au lieu de 33,33% si la société de gestion appliquait strictement le seuil de 5%.

Le mécanisme d'échelonnement des rachats ne peut être déclenché plus de vingt fois sur une période de trois mois et ne peut durer plus d'un mois. Au-delà, la société de gestion mettra automatiquement fin au mécanisme d'échelonnement des rachats et envisagera une autre solution exceptionnelle (telle que la suspension des rachats par exemple) si la situation l'exige.

(iv) Cas d'exonération

Les opérations de souscription et de rachat, pour un même nombre de parts, sur la base de la même valeur liquidative et pour un même porteur ou ayant droit économique (opérations d'aller-retour) ne sont pas soumises au dispositif de plafonnement des rachats.

ARTICLE 4 - Calcul de la valeur liquidative

Le calcul de la valeur liquidative de la part est effectué en tenant compte des règles d'évaluation figurant dans le prospectus.

Les apports en nature ne peuvent comporter que les titres, valeurs ou contrats admis à composer l'actif des OPCVM. Les apports et les rachats en nature sont évalués conformément aux règles d'évaluation applicables au calcul de la valeur liquidative.

TITRE II

FONCTIONNEMENT DU FCP

ARTICLE 5 - La société de gestion

La gestion du FCP est assurée par la société de gestion conformément à l'orientation définie pour le FCP.

La société de gestion agit en toutes circonstances dans l'intérêt exclusif des porteurs de parts et peut seule exercer les droits de vote attachés aux titres compris dans le FCP.

ARTICLE 5 bis - Règles de fonctionnement

Les instruments et dépôts éligibles à l'actif du FCP ainsi que les règles d'investissement sont décrits dans le prospectus.

ARTICLE 6 - Le dépositaire

Le dépositaire assure les missions qui lui incombent en application des lois et règlements en vigueur ainsi que celles qui lui ont été contractuellement confiées par la société de gestion. Il doit notamment s'assurer de la régularité des décisions de la société de gestion. Il doit, le cas échéant, prendre toutes les mesures conservatoires qu'il juge utiles. En cas de litige avec la société de gestion, il en informe l'Autorité des marchés financiers.

Dans le cas où le FCP est un FIA nourricier, le dépositaire a conclu une convention d'échange d'information avec le dépositaire de l'OPCVM maître, ou le cas échéant quand il est également dépositaire de l'OPCVM ou maître, il a établi un cahier des charges adapté.

ARTICLE 7 - Le commissaire aux comptes

Un commissaire aux comptes est désigné pour six exercices, après accord de l'Autorité des marchés financiers, par l'organe de gouvernance de la société de gestion ou son Président.

Il certifie la régularité et la sincérité des comptes.

Il peut être renouvelé dans ses fonctions.

Il est tenu de signaler dans les meilleurs délais à l'Autorité des marchés financiers tout fait ou toute décision concernant le FCP dont il a eu connaissance dans l'exercice de sa mission, de nature :

- 1° A constituer une violation des dispositions législatives ou réglementaires applicables au FCP et susceptible d'avoir des effets significatifs sur la situation financière, le résultat ou le patrimoine ;
- 2° A porter atteinte aux conditions ou à la continuité de son exploitation ;
- 3° A entraîner l'émission de réserves ou le refus de la certification des comptes.

Les évaluations des actifs et la détermination des parités d'échange dans les opérations de transformation, fusion ou scission sont effectuées sous le contrôle du commissaire aux comptes.

Il apprécie tout apport ou rachat en nature sous sa responsabilité hormis dans le cadre de rachats en nature pour un ETF sur le marché primaire.

Il contrôle la composition de l'actif et des autres éléments avant publication.

Les honoraires du commissaire aux comptes sont fixés d'un commun accord entre celui-ci et le conseil d'administration ou le directoire de la société de gestion au vu d'un programme de travail précisant les diligences estimées nécessaires. Il atteste les situations servant de base à la distribution d'acomptes.

Dans le cas où le FCP est un FIA nourricier :

- le commissaire aux comptes a conclu une convention d'échange d'information avec le commissaire aux comptes de l'OPCVM ou du FIA maître.
- lorsqu'il est également commissaire aux comptes du FIA nourricier et de l'OPCVM ou du FIA maître, il établit un programme de travail adapté.

Ses honoraires sont compris dans les frais de gestion.

ARTICLE 8 - Les comptes et le rapport de gestion

A la clôture de chaque exercice, la société de gestion établit les documents de synthèse, et établit un rapport sur la gestion du FCP, le cas échéant relatif à chaque compartiment, pendant l'exercice écoulé.

La société de gestion établit, au minimum de façon semestrielle et sous contrôle du dépositaire, l'inventaire des actifs du FCP.

La société de gestion tient ces documents à la disposition des porteurs de parts dans les quatre mois suivant la clôture de l'exercice et les informe du montant des revenus auxquels ils ont droit : ces documents sont soit transmis par courrier à la demande expresse des porteurs de parts, soit mis à leur disposition chez la société de gestion.

TITRE III

MODALITES D'AFFECTION DES SOMMES DISTRIBUABLES

ARTICLE 9 - Modalités d'affectation des sommes distribuables

Le résultat net de l'exercice est égal au montant des intérêts, arrérages, dividendes, primes et lots, jetons de présence ainsi que tous produits relatifs aux titres constituant le portefeuille du FCP et le cas échéant de chaque compartiment majoré du produit des sommes momentanément disponibles et diminué des frais de gestion et de la charge des emprunts.

Les sommes distribuables sont égales :

- 1) au résultat net de l'exercice augmenté des reports à nouveau et majoré ou diminué du solde des comptes de régularisation des revenus
- 2) aux plus-values réalisées, nettes de frais, diminuées des moins-values réalisées, nettes de frais, constatées au cours de l'exercice, augmentées des plus-values nettes de même nature constatées au cours d'exercices antérieurs n'ayant pas fait l'objet d'une capitalisation et diminuées ou augmentées du solde du compte de régularisation des plus-values.

La société de gestion décide de l'affectation des sommes distribuables (résultats et plus-values nettes réalisées). Elle peut également décider de verser des acomptes et/ou de porter en report les résultats nets et/ou plus-values nettes réalisées.

Le FCP peut émettre plusieurs catégories de parts pour lesquelles les modalités d'affectation des sommes distribuables sont précisées dans le prospectus.

TITRE IV

FUSION - SCISSION - DISSOLUTION - LIQUIDATION

ARTICLE 10 - Fusion - Scission

La société de gestion peut soit faire apport, en totalité ou en partie, des actifs compris dans le FCP à un autre OPCVM ou FIA, soit scinder le FCP en deux ou plusieurs autres fonds communs.

Ces opérations de fusion ou de scission ne peuvent être réalisées qu'après que les porteurs en ont été avisés. Elles donnent lieu à la délivrance d'une nouvelle attestation précisant le nombre de parts détenues par chaque porteur.

Les dispositions du présent article s'appliquent le cas échéant à chaque compartiment.

ARTICLE 11 - Dissolution – Prorogation

- Si les actifs du FCP ou le cas échéant du compartiment, demeurent inférieurs, pendant trente jours, au montant fixé à l'article 2 ci-dessus, la société de gestion en informe l'Autorité des marchés financiers et procède, sauf opération de fusion avec un autre Fonds Commun de Placement, à la dissolution du FCP ou le cas échéant du compartiment.
- La société de gestion peut dissoudre par anticipation le FCP ou le cas échéant un compartiment ; elle informe les porteurs de parts de sa décision et à partir de cette date les demandes de souscription ou de rachat ne sont plus acceptées.
- La société de gestion procède également à la dissolution du FCP ou le cas échéant du compartiment en cas de demande de rachat de la totalité des parts, de cessation de fonction du dépositaire, lorsqu'aucun autre dépositaire n'a été désigné, ou à l'expiration de la durée du FCP, si celle-ci n'a pas été prorogée.

La société de gestion informe l'Autorité des marchés financiers par courrier de la date et de la procédure de dissolution retenue. Ensuite, elle adresse à l'Autorité des marchés financiers le rapport du commissaire aux comptes.

La prorogation d'un FCP peut être décidée par la société de gestion en accord avec le dépositaire. Sa décision doit être prise au moins 3 mois avant l'expiration de la durée prévue pour le FCP et portée à la connaissance des porteurs de parts et de l'Autorité des marchés financiers.

ARTICLE 12 – Liquidation

En cas de dissolution, la société de gestion assume les fonctions de liquidateur ; à défaut, le liquidateur est désigné en justice à la demande de toute personne intéressée. Elle est investie à cet effet, des pouvoirs les plus étendus pour réaliser les actifs, payer les créanciers éventuels et répartir le solde disponible entre les porteurs de parts en numéraire ou en valeurs.

Le commissaire aux comptes et le dépositaire continuent d'exercer leurs fonctions jusqu'à la fin des opérations de liquidation.

Les actifs des compartiments sont attribués aux porteurs de parts respectifs de ces compartiments.

TITRE V

CONTESTATION

ARTICLE 13 - Compétence - Election de Domicile

Toutes contestations relatives au FCP qui peuvent s'élever pendant la durée de fonctionnement de celui-ci, ou lors de sa liquidation, soit entre les porteurs de parts, soit entre ceux-ci et la société de gestion ou le dépositaire, sont soumises à la juridiction des tribunaux compétents.