

DASHBOARD AU 28.02.2025

Classe d'actifs	Stratégie d'investissement	Région	Actif du compartiment (EUR mn.)
Investissements alternatifs & Autres	SQI Protected Systematic Structured	Monde	33
Niveau de risque et de rendement	Performance YTD (1)	Perf. annualisée sur 3 ans (2)	Code ISIN
<div style="display: flex; justify-content: space-between; width: 100px;"> 1 2 3 4 5 6 7 </div>	-0,47%	-	FR0014009RK8

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

(2) Basée sur 360 jours

POLITIQUE D'INVESTISSEMENT

Capital non garanti en cours de vie et à l'échéance. Objectif de gestion : L'objectif de gestion du FCP est de permettre au porteur dont les parts du FCP ont été centralisées au plus tard le 25 août 2022 à 13 heures, heure de Paris, en fonction de l'évolution de l'indice ECPI Global ESG Future Mobility NTR Index 3.5% Decrement (ci-après l'« Indice ») : - d'obtenir, le 1er septembre 2025 (ci-après « Date de Constatation Intermédiaire »), (i) une possibilité d'échéance anticipée dès lors que l'Indice clôture avec une performance supérieure ou égale à 15% par rapport à son niveau initial, qui est le niveau de clôture observé le 29 août 2022 (ci-après « Date de Constatation Initiale », et, (ii) en cas d'échéance anticipée, de bénéficier d'une valeur liquidative au minimum égale à la Valeur Liquidative de Référence ou « VLR » augmentée d'un gain fixe et plafonné de 15%, - ou de participer à horizon 6 ans, le 29 août 2028 (ci-après « Date de Constatation Finale », à la performance positive de l'Indice, en contrepartie d'un risque de perte de son capital investi (ci-après « Capital Investi ») en fonction de la performance de l'Indice, selon les conditions ci-dessous : . en cas de baisse de l'Indice de plus de 40%, le porteur subira, à la Date d'échéance, le 5 septembre 2028, une perte en capital correspondant à l'intégralité du pourcentage de baisse de l'Indice, soit une perte de plus de 40% pouvant aller jusqu'à la totalité de son Capital Investi, . en cas de hausse de l'Indice jusqu'à 6% inclus ou de baisse de l'Indice jusqu'à 40% inclus, le porteur bénéficiera à la Date d'échéance d'une valeur liquidative au minimum égale à la Valeur Liquidative de Référence augmentée de 6%, en cas de hausse de l'Indice supérieure à 6%, le porteur bénéficiera à la Date d'Echéance d'une valeur liquidative au minimum égale à la Valeur Liquidative de Référence augmentée de la performance positive de l'Indice (constatée en clôture de la Date de Constatation Finale par rapport à son Niveau Initial constaté en clôture de la Date de Constatation Initiale. Caractéristiques essentielles du FCP : La Valeur Liquidative de Référence est définie comme la plus haute valeur liquidative du FCP parmi les valeurs liquidatives dont la première porte la date du 24 mai 2022 et la dernière est celle du 26 août 2022. Les souscriptions sont retenues pour leur montant, déduction faite de la commission de souscription, hors fiscalité et prélèvements sociaux, ou déduction faite, le cas échéant, des frais d'entrée propres au cadre d'investissement dans le FCP. Le Capital Investi correspond à l'investissement initial du porteur pour toute souscription centralisée à compter du 23 mai 2022 (inclus) et jusqu'au 25 août 2022 (inclus) à 13 heures, heure de Paris, déduction faite de la commission de souscription, hors fiscalité et prélèvements sociaux, ou déduction faite, le cas échéant, des frais d'entrée propres au cadre d'investissement dans le FCP. Le FCP est éligible au Plan d'Épargne en Actions (PEA) et maintient en conséquence dans ses actifs au moins 75% de titres de toutes capitalisations de pays appartenant à l'OCDE, libellés en euros et éligibles au PEA. Il peut également détenir jusqu'à 25% d'obligations françaises et étrangères et d'autres titres de créance négociables français et/ou étrangers émis ou garantis par un Etat membre de l'OCDE, et des placements monétaires. 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 des instruments de dette. Jusqu'à la totalité de son actif net pourra également être investie en parts ou actions d'OPC. Le FCP a enfin vocation à intervenir sur les marchés à terme réglementés et de gré à gré, et en particulier recourir aux futures, aux options, aux swaps et aux dérivés de crédit à des fins de couvertures et/ou d'exposition. Avantages de la formule : - Dans le cas d'une échéance anticipée, le porteur bénéficie d'un gain fixe et plafonné de 15%, soit un rendement annualisé de 4,62%. - Sinon, à la Date d'Echéance, dans le cas où la Condition d'Echéance Anticipée n'a pas été remplie à la Date de Constatation Intermédiaire : . Si à la Date de Constatation Finale, le 29 août 2028, l'Indice clôture en hausse par rapport à son niveau initial, le porteur bénéficie de la totalité de la performance positive de l'Indice par rapport à son niveau initial, sans plafonnement ; . Si à la Date de Constatation Finale, le 29 août 2028, l'Indice affiche une baisse jusqu'à 40% (inclus) par rapport à son niveau initial, le porteur récupère son Capital Investi alors que la performance de l'Indice serait négative. - L'indice ECPI Global ESG Future Mobility NTR Index 3.5% Decrement est un indice diversifié géographiquement qui est construit afin d'offrir aux investisseurs une exposition aux entreprises impliquées dans les activités de flottes partagées, la production de véhicules autonomes et électriques, les entreprises produisant et assemblant des technologies de stockage et l'extraction de métaux rares utilisés pour fabriquer des batteries. Cela n'implique toutefois pas que les fonds levés seront spécifiquement alloués au financement de projets répondant à des thématiques ESG, ni aux entreprises les plus performantes en matière de mobilité future. En effet, seul l'indice est construit de façon à sélectionner des actifs présentant ces caractéristiques. La diversification de l'Indice permet de réduire le risque d'exposition à un pays. Inconvénients de la formule :- Le capital n'est pas garanti. Le FCP présente un risque de perte en capital. - Le porteur ne connaît pas a priori l'échéance du FCP qui peut être de 3 ans ou de 6 ans, selon l'évolution de l'Indice. - Le résultat de la formule ne s'applique qu'aux porteurs dont les parts ont été centralisées avant le 25 août 2022 à 13 heures (heure de Paris) et les ayant conservées jusqu'à la Date d'Echéance Anticipée ou la Date d'Echéance, selon l'évolution de l'Indice. - Dans le cas où la Condition d'Echéance Anticipée est remplie, le gain fixe est plafonné à 15%, soit un rendement annualisé de 4,62 %. Le porteur ne profitera donc pas de l'intégralité de la hausse de l'Indice si celle-ci est supérieure. - En investissant dans ce FCP, le porteur s'expose dans le cas où la Condition d'Echéance Anticipée n'est pas remplie à la Date de Constatation Intermédiaire, à un risque de perte en capital si l'Indice subit une perte de plus de 40% le 29 août 2028 par rapport à son niveau du 29 août 2022. Dans ce cas, la Valeur Liquidative du FCP à la Date d'Echéance sera égale à la Valeur Liquidative de Référence diminuée de l'intégralité du pourcentage de baisse de l'Indice, ce qui correspond à une perte en capital de plus de 40% (soit un taux de rendement annuel du FCP inférieur à -8,13%), pouvant aller jusqu'à la totalité de son Capital Investi. - L'Indice



est calculé en réinvestissant les dividendes nets détachés par les actions qui le composent et en retranchant un prélèvement forfaitaire de 3,5% par an. Ce prélèvement forfaitaire, fixé lors de la conception de l'indice a un impact négatif sur son niveau par rapport au même indice dividendes nets réinvestis, sans prélèvement forfaitaire. Si les dividendes distribués sont inférieurs au niveau de prélèvement forfaitaire, la performance de l'indice en sera pénalisée par rapport à un indice dividendes non réinvestis classique. Le FCP est géré activement et de manière discrétionnaire. Il n'est pas géré en référence à un indice. Autres informations : Durée minimum de placement recommandée : 6 ans et 7 jours maximum (jusqu'au 5 septembre 2028). Il est fortement recommandé de n'acheter des parts de ce FCP que si vous avez l'intention de les conserver jusqu'à la Date d'Echéance : 5 septembre 2028. Les demandes de souscriptions sont centralisées à partir du lendemain de la création du FCP et jusqu'au 25 août 2022 inclus à 13 heures (heure de Paris). Les porteurs peuvent demander le rachat de leurs parts du lundi au vendredi jusqu'à 13h (heure de Paris). Les demandes de rachat seront exécutées sur la valeur liquidative datée du lendemain ouvré. Tout rachat effectué sur la base d'une valeur liquidative autre que celle datée de la Date d'Echéance Anticipée (en cas de réalisation de la Condition d'échéance Anticipée) ou celle datée de la Date d'Echéance (si la Condition d'Echéance Anticipée ne s'est pas réalisée), se fera aux conditions de marché applicables au moment du rachat.

PERFORMANCES Evolution de la VL EUR (NET)



Performances cumulées au 28.02.2025 (en %)

	YTD	1 mois	3 mois	6 mois	1 an	2 ans	3 ans	4 ans	5 ans
● FONDS	-0,47	-1,38	-0,34	2,15	4,66	15,67	-	-	-

Performances calendaires au 28.02.2025 (en %)

	2024	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015
● FONDS	7,33	14,91	-	-	-	-	-	-	-	-

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



POSITIONS : % DU PORTEFEUILLE

Principales positions

ENGIE SA	26,82
BNP PARIBAS SA	24,60
CREDIT AGRICOLE SA	14,42
VEOLIA ENVIRON. SA	6,49
JUST EAT TAKEAWAY.COM NV	4,90
ADYEN NV	4,56
AMUNDI SA	4,28
MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS	3,90
UMICORE SA	3,16
SOCIETE GENERALE SA	2,30
Nb de positions dans le portefeuille	13

Source : BNP Paribas Asset Management, en date du 28.02.2025

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



RISQUE

Niveau de risque et de rendement



Risque plus faible

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit jusqu'à la date du 05.09.2028.

Le risque réel peut être très différent si vous optez pour une sortie avant échéance, et vous pourriez obtenir moins en retour.

Risque plus élevé

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 4 sur 7, qui est une classe de risque moyenne.

La gestion structurée et l'horizon d'investissement justifient la catégorie de risque. Un rachat avant la date d'échéance peut être associé à un niveau de risque plus élevé.

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 lié aux instruments dérivés :** l'utilisation d'instruments dérivés peut amplifier les variations de la valeur des investissements et donc accroître la volatilité des rendements.

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

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

DÉTAILS

Commissions		Chiffres clés		Codes	
Frais d'entrée max.	1,00%	VL	1 056,61	Code ISIN	FR0014009RK8
Frais de sortie max.	0,00%	12M VL max. (19.02.25)	1 084,14	Code Bloomberg	BNPJCAP FP
Frais courants estimés (31.12.24)	2,10%	12M VL min. (05.08.24)	977,12		
Commission de gestion max.	4,00%	Actif du compartiment (EUR mn.)	33,31		
		Première VL	999,94		
		Périodicité de calcul de la VL	Journalière		

Caractéristiques

Forme juridique	FCP (Fonds commun de placement) BNP PARIBAS APOLLO GLOBAL ESG FUTURE MOBILITY de droit français
Durée d'investissement recommandée	Conserver jusqu'à échéance 05.09.2028
Domiciliation	France
Gérant(s)	Nadia MASRAR
Société de gestion	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe
Gérant délégué	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK LIMITED
Dépositaire	BNP PARIBAS
Devise de base	EUR
Article SFDR	6



GLOSSAIRE

Ratio de Sharpe

Mesure du rendement, corrigé du risque pris. Indique le rendement supplémentaire (au-dessus du taux sans risque) qui a été obtenu par unité de risque qui a été pris. Se calcule en divisant la différence entre le rendement obtenu et le taux sans risque par l'écart-type des rendements de l'investissement. Le 'ratio de Sharpe' indique si le rendement a été obtenu grâce à une bonne gestion ou en prenant des risques supplémentaires. Plus le ratio est élevé, plus le rapport risque-rendement peut être considéré comme positif.

Volatilité

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

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

DISCLAIMER

Ce document présente les caractéristiques des supports financiers éligibles aux dispositifs d'épargne salariale et d'assurance collective du Groupe BNP Paribas. Il contient des éléments d'information et des données chiffrées considérés comme fondés ou exacts le jour de leur établissement. Il est produit à titre d'information et ne doit pas être considéré comme une offre de vente ou de prescription. Nous vous rappelons que les notices de ces supports doivent être remises à vos salariés afin que ceux-ci puissent prendre connaissance de leurs caractéristiques avant toute décision d'investissement. Celles-ci sont mises à leur disposition dans leurs espaces privés accessibles à partir de notre site Internet www.epargneretraite-entreprises.bnpparibas.com. Les performances passées ne préjugent pas des résultats futurs. Le FCPE présente un risque de perte en capital.

BNP Paribas Epargne & Retraite Entreprises - www.epargne-retraite-entreprises.bnpparibas.com

BNP Paribas Epargne & Retraite Entreprises est un Métier de BNP Paribas SA au capital de 2 499 597 122 € - Siège social : 16, bd des Italiens - 75009 Paris Immatriculée sous le n° 662 042 449 RCS Paris - Identifiant CE : FR 76662042449 - Immatriculée à l'Orias sous le n° 07 022 735 - www.bnpparibas.com
11-12-002 Studio E&RE - Decembre 2019

