

DASHBOARD AL 31.05.2024

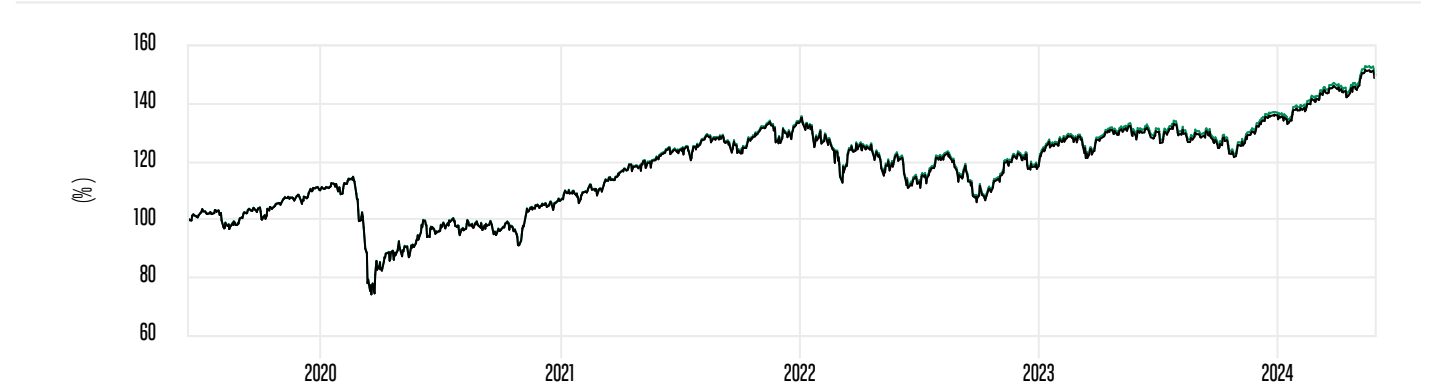
Label
ISR

Classi di attivo	Benchmark ufficiale	Posizioni del benchmark	Patrimonio del fondo (EUR mln)
Azioni	MSCI Europe ESG Filtered Min TE (EUR) NR	325	997
Valuta di negoziazione	Indice di comparazione	Articolo SFDR	MSCI ESG Fund Rating
EUR	MSCI Europe (EUR) NR	8	AA

DESCRIZIONE DELL'INDICE:

L'Indice è costituito da società europee selezionate sulla base di criteri ambientali, sociali e di governance (ESG) (opportunità ambientali, inquinamento e rifiuti, capitale umano, governo societario, ecc.) nonché sui relativi sforzi per ridurre la rispettiva esposizione al carbone e ai combustibili fossili non convenzionali, al contempo riducendo al minimo il tracking error rispetto all'indice principale, l'MSCI Europe. Di conseguenza, sono escluse dall'Indice le società operanti in settori con ripercussioni negative potenzialmente elevate sui criteri ESG, quelle cui sono associate violazioni significative dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite e quelle coinvolte in gravi controversie correlate ai suddetti criteri. Il tipo di approccio qui impiegato è Best-in-Universe (ossia un tipo di selezione ESG che consiste nel dare priorità agli emittenti con la valutazione migliore da un punto di vista non finanziario, indipendentemente dal loro settore di attività, e nell'accettare bias settoriali, poiché i settori che vengono considerati complessivamente più virtuosi saranno maggiormente rappresentati). La strategia extrafinanziaria dell'Indice, realizzata in ogni fase del processo d'investimento, può comprendere limiti metodologici quali il rischio relativo agli investimenti ESG o al ribilanciamento dell'Indice. Ulteriori informazioni sull'Indice, la composizione, il calcolo e le regole dell'indice stesso ai fini di analisi e ribilanciamento periodici, così come sulla metodologia generale alla base degli indici MSCI, sono reperibili sul sito internet: www.msci.com. L'indice di confronto è il MSCI Europe (EUR) NR.

PERFORMANCE (CUMULATE SU 5 ANNI) (EUR)



Performance Cumulata al 31.05.2024 (in %)

	YTD	1 Mese	3 Mesi	6 Mesi	1 Anni	2 Anni	3 Anni	4 Anni	5 Anni
● FONDO	10,47	3,51	6,84	14,72	17,77	23,81	25,03	62,28	55,84
● INDICE DI RIFERIMENTO	10,25	3,43	6,65	14,52	17,55	23,39	24,23	61,06	54,33
● INDICE DI COMPARAZIONE	10,14	3,26	6,36	14,22	17,56	23,66	27,37	65,16	58,16

Performance dell'Anno Solare al 31.05.2024 (in %)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
● FONDO	16,06	-11,65	25,35	-3,19	26,39	-10,60	10,30	2,10	9,30	6,40
● INDICE DI RIFERIMENTO	15,86	-11,84	25,12	-3,33	26,11	-10,60	10,30	2,10	9,30	6,60
● INDICE DI COMPARAZIONE	15,83	-9,49	25,13	-3,32	26,05	-	-	-	-	-

(1) Performance al netto delle commissioni (in EUR in UCITS ETF, Capitalizzazione). Le performance e i risultati passati non sono indicativi dei rendimenti attuali o futuri. I dati sulla performance sono riportati al netto delle commissioni di gestione.
10/2010-02/2016: A seguito di un evento societario in data 12/02/2016, i rendimenti elencati corrispondono alla simulazione dei risultati ottenuti nel passato e delle commissioni di PARWORLD TRACK EUROPE.
02/2016 - 12/2021: Nel corso di questo periodo, l'indice di riferimento è stato MSCI Europe ex Controversial Weapons (NTR).
Fonte: BNP Paribas Asset Management



BENCHMARK POSIZIONI: (in %)

Principali Posizioni (%)			Against Comparison Index	per Paese (%)			Against Comparison Index
NOVO NORDISK CLASS B B	4,06		+ 0,11	Regno Unito	17,25		- 0,31
ASML HOLDING NV	3,44		+ 0,05	Francia	15,67		- 0,77
SHELL PLC	2,32		+ 0,26	Svizzera	13,41		- 1,41
ASTRAZENECA PLC	2,27		+ 0,11	Germania	11,40		- 1,55
NOVARTIS AG N	2,07		+ 0,24	Paesi Bassi	10,07		+ 1,02
LVMH	2,04		+ 0,06	Danimarca	6,17		+ 0,43
SAP	1,79		+ 0,10	Svezia	5,06		+ 0,16
TOTALENERGIES	1,67		+ 0,27	Spagna	4,61		+ 0,61
HSBC HOLDINGS PLC	1,56		+ 0,06	Italia	3,96		+ 0,18
UNILEVER PLC	1,43		+ 0,21	Stati Uniti	2,75		- 0,07
N.ro Principali Posizioni del Benchmark			325	Altro	9,64		+ 1,72
				Liquidità	-		+ 0,00
				Totale	100,00		

per Settore (%)			Against Comparison Index	per Valuta (%)			Against Comparison Index
Finanziari	22,05		+ 3,36	EUR	51,49		+ 0,31
Industriali	14,53		- 2,28	GBP	22,37		- 0,21
Salute	13,80		- 1,96	CHF	12,92		- 1,47
Beni di prima necessità	10,34		- 0,36	DKK	6,17		+ 0,43
Consumi discrezionali	9,87		- 0,57	SEK	5,06		+ 0,16
Tecnologia	8,11		+ 0,38	NOK	1,50		+ 0,60
Materiali	6,91		+ 0,36	USD	0,49		+ 0,18
Energia	5,27		- 0,22	CAD	-		- 0,00
Utilities	4,73		+ 0,84	Totale	100,00		
Comunicazioni	3,21		+ 0,13				
Altro	1,17		+ 0,31				
Liquidità	-		+ 0,00				
Totale	100,00						

Fonte: BNP Paribas Asset Management, al 31.05.2024.

Titoli menzionati a mero scopo illustrativo. Non si intende sollecitare all'acquisto, né fornire raccomandazioni o consulenza all'investimento.

I dati riportati nelle factsheet si basano su dati contabili ufficiali e si riferiscono alla data di negoziazione.



BNPPAM INDICATORI EXTRA FINANZIARI

Punteggio totale ESG
61,73

CONTRIBUTI ESG

	Contributo 'Ambientale'	Contributo 'Sociale'	Contributo 'Governance'
Portfolio	4,37	4,21	3,15

COPERTURA DI PORTAFOGLIO

	Copertura
Copertura ESG	99,76%

CARATTERISTICHE DI SOSTENIBILITÀ MSCI (COME DISPONIBILE SUL SITO WEB DEL MSCI ALLA FINE DEL MESE PRECEDENTE)

MSCI ESG Fund Rating	AA		
MSCI Weighted Average Carbon Intensity (ton of CO2e/\$ M Sales)	94.88	MSCI Weighted Average Carbon Intensity Coverage	99.16%
MSCI ESG Quality Score (0-10)	8.36		

Punteggio totale di copertura ESG

La metodologia interna di BNPP AM determina il punteggio ESG degli emittenti valutando la loro performance rispetto a società pari (peer group) sulla base di un numero limitato di criteri ESG relativi all'ambiente (es. cambiamento climatico) e alle problematiche sociali (es. gestione delle risorse umane) e corporate governance (es. indipendenza e competenza dei dirigenti). L'universo di investimento è suddiviso per area geografica e per settore, il che consente di comporre gruppi di società comparabili (peer group). BNPP AM utilizza molte ricerche e fonti di dati (tra cui Sustainalytics, ISS e Trucost) per calcolare i punteggi ESG per le aziende. Se gli impegni e le pratiche dell'emittente su uno dei criteri di valutazione (E, S o G) sono migliori di quelli dei suoi concorrenti, gli viene assegnato un contributo positivo su tale criterio. Ad ogni emittente viene assegnato un punteggio da 1 a 99, che corrisponde ad una base neutra di 50 a cui si aggiunge la somma dei contributi su ciascuno dei tre criteri di valutazione. (es: 50 +2 (E) -1 (S) +3 (G) = 54 punteggio globale ESG).

Contributi ESG

I contributi ESG sono determinati dagli analisti ESG di BNP Paribas Asset Management sulla base di criteri dettagliati per valutare sistematicamente gli impegni e le pratiche delle aziende in ambito ambientale, sociale e governance. Ciascuno dei contributi di cui sopra, è la media ponderata dei contributi delle singole partecipazioni in portafoglio. Il contributo ambientale (E) tiene conto, tra le altre cose, del cambiamento climatico, della gestione del rischio ambientale e dell'uso delle risorse naturali. Il contributo sociale (S) tiene conto, tra le altre cose, della gestione del capitale umano, della qualità del dialogo sociale e del rispetto della diversità. Il contributo della governance (G) tiene conto, tra le altre cose, della trasparenza sulla remunerazione dei dirigenti, della lotta alla corruzione e dell'uguaglianza di genere.

Copertura di portafoglio

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

MSCI ESG Fund Rating

Il rating MSCI ESG è calcolato come mappatura diretta dei punteggi di qualità ESG alle categorie di rating delle lettere (ad es. AAA = 8.6-10). I rating ESG variano da leader (AAA: AA), media (A, BBB, BB) a laggard (B, CCC).

MSCI Weighted Average Carbon Intensity

Misura l'esposizione di un fondo alle società ad alta intensità di carbonio. Questo dato rappresenta le emissioni stimate di gas serra per 1 milioni \$ nelle vendite delle partecipazioni del fondo. Ciò consente confronti tra fondi di dimensioni diverse.

MSCI Weighted Average Carbon Intensity Coverage

È la percentuale delle partecipazioni del fondo per cui sono disponibili i dati MSCI Carbon Intensity. La metrica MSCI Weighted Average Carbon Intensity è visualizzata per i fondi con qualsiasi copertura. I fondi con una bassa copertura potrebbero non rappresentare appieno le caratteristiche del carbonio del fondo a causa della mancanza di copertura.

MSCI ESG Quality Score (0-10)

L'indice MSCI ESG Quality Score (0-10) per i fondi è calcolato utilizzando la media ponderata dei punteggi ESG delle posizioni dei fondi. Il Punteggio considera anche l'andamento dei rating ESG e l'esposizione del fondo alle posizioni nella categoria laggard. Tassi MSCI sottostanti le posizioni in base alla loro esposizione ai rischi ESG specifici del settore e alla loro capacità di gestire tali rischi rispetto ai concorrenti.

Per avere più informazioni sui criteri ESG, visita la pagina del sito BNPP AM: <https://www.bnpparibas-am.com/en/esg-scoring-framework/> & <https://www.bnpparibas-am.com/en/measuring-carbon-footprints/>

Per informazioni più dettagliate sui nostri documenti di sostenibilità, si prega di fare riferimento alla pagina web di BNPP AM: <https://www.bnpparibas-am.com/en/sustainability-documents/>



RISCHIO

Profilo di Rischio e di Rendimento



Analisi del Rischio (1 anno, settimanale)

Fondo

Volatilità	11,21
Tracking Error	0,07
Tracking Error Official Benchmark/Comparison Index	0,77
Sharpe Ratio	1,08

L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o della nostra incapacità di pagare quanto dovuto.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 4 su 7, che corrisponde alla classe di rischio media.

La categoria di rischio è giustificata dall'investimento prevalentemente in Titoli e Azioni, il cui valore può fluttuare in misura considerevole. Tali fluttuazioni sono spesso amplificate nel breve termine.

Siate consapevoli del rischio valutario: se la valuta del vostro conto è diversa dalla valuta di questo Prodotto, i pagamenti che otterrete dipenderanno dal tasso di cambio tra le due valute. Questo rischio non è considerato nell'indicatore riportato sopra.

Altri rischi rilevanti per il Prodotto non inclusi nell'indicatore sintetico di rischio:

- **Rischio operativo:** in caso di fallimento operativo della Società di gestione, di uno dei suoi rappresentanti o del depositario, gli investitori potrebbero subire diversi inconvenienti (ritardi nei pagamenti, nella consegna, ecc.).

Per ulteriori dettagli sui rischi, si rimanda al prospetto.

Questo prodotto non prevede alcuna protezione dall'andamento futuro del mercato e pertanto potreste perdere la totalità o parte dell'investimento.

DETTAGLI

Commissioni

Comm. di Sottoscrizione Max.	3,00%
Comm. di Rimborso Max. (31.05.24)	3,00%
Commissione di Conversione max.	0,00%
Spese Correnti (31.12.23)	0,15%
Commissione di Gestione Max.	0,03%

Codici

ISIN Code	LU1291099718
Bloomberg Code	EEUE FP

Dati dell'indice al 31.05.2024

Nome	MSCI Europe ESG Filtered Min TE (EUR) NR
Bloomberg Code	M4EUCW
Reuters Code	.MIEU0XC00NEU

Numeri Chiave

NAV	15,73
Patrimonio del fondo (Euro mln)	996,52

Caratteristiche

Forma Giuridica	Comparto di SICAV BNP PARIBAS EASY di diritto Luxembourg
Orizzonte Temporale Raccomandato	5
Indice di Riferimento	MSCI Europe ESG Filtered Min TE (EUR) NR
Domicilio	Lussemburgo
Data di Lancio	12.02.2016
Gestore(s) del Fondo	Jean Claude LEVEQUE
Società di Gestione	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg
Società di Gestione Delegata	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe
Banca Depositaria	BNP PARIBAS, Luxembourg Branch
Valuta Base	EUR



Caratteristiche

Esecuzione degli ordini	NAV + 1
SFDR article	Articolo 8 - Promozione delle caratteristiche ambientali o sociali



GLOSSARIO

Tracking Error

Il tracking error misura la volatilità del rendimento relativo di un portafoglio rispetto al suo indice di riferimento.

Volatilità

La volatilità di un attivo è la deviazione standard del tasso di rendimento. In quanto misura della dispersione, valuta l'incertezza dei prezzi degli attivi, che è spesso assimilata al loro rischio. La volatilità può essere calcolata ex post (retrospettivamente) o stimata ex ante (in anticipo).

È possibile consultare un glossario dei termini finanziari riportati nel presente documento all'indirizzo <http://www.bnpparibas-am.com>

DISCLAIMER

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Italian branch succursale di Milano, è iscritta nell'elenco allegato all'Albo delle SGR di cui all'art. 35 del D.Lgs. 58/1998, alle sezioni società di gestione UE e gestori FIA UE del risparmio, autorizzata in Italia dalla Banca d'Italia, ha sede legale al n. 3 di P.zza Lina Bo Bardi a Milano. www.bnpparibas-am.it.

Il presente documento è redatto dalla suddetta società di gestioni di investimenti. Ha natura pubblicitaria e viene diffuso con finalità promozionali, è prodotto a mero titolo informativo e non costituisce:

1. un'offerta di acquisto o una sollecitazione di vendita; non costituirà la base di qualsivoglia contratto o impegno né ci si potrà fare affidamento in relazione a questi ultimi;
2. una consulenza finanziaria.

Il presente documento fa riferimento a uno o più strumenti finanziari autorizzati e regolamentati nella giurisdizione in cui hanno sede legale.

Non è stata avviata alcuna azione finalizzata a permettere l'offerta pubblica degli strumenti finanziari in altre giurisdizioni, salvo quanto indicato nella versione più recente del prospetto e nel documento contenente le informazioni chiave per l'investitore (KID) degli strumenti finanziari, in cui una tale azione sarebbe necessaria e, in particolare, negli Stati Uniti, a US persons (ai sensi del Regolamento S del United States Securities Act del 1933). Prima di effettuare una sottoscrizione in un Paese in cui gli strumenti finanziari sono autorizzati, gli investitori devono verificare gli eventuali vincoli o restrizioni legali potenziali relativi alla sottoscrizione, all'acquisto, al possesso o alla vendita degli strumenti finanziari in questione.

Gli investitori che intendano sottoscrivere degli strumenti finanziari devono, prima dell'adesione, leggere attentamente la versione più recente del prospetto e del documento contenente le informazioni chiave per l'investitore (KID) e consultare l'ultima relazione finanziaria pubblicata sugli strumenti finanziari in questione. Questa documentazione è disponibile nella lingua del collocatore o in inglese, gratuitamente presso le sedi dei collocatori e le filiali dei soggetti incaricati dei pagamenti, nonché sul sito web della società di gestione di investimenti www.bnpparibas-am.com, nella sezione "Panorama dei fondi".

Le opinioni espresse nel presente documento rappresentano il parere della società di gestione di investimenti alla data indicata e sono soggette a modifiche senza preavviso. La società di gestione di investimenti non è obbligata ad aggiornare o a modificare le informazioni e le opinioni contenute nel presente documento. Si raccomanda agli investitori di consultare i loro abituali consulenti finanziari, legali e fiscali per valutare l'adeguatezza e l'opportunità di investire negli strumenti finanziari. Si noti che i diversi tipi di investimento, se contenuti in questo documento, comportano gradi di rischio differenti e nessuna garanzia può essere fornita circa l'adeguatezza, l'idoneità o la redditività di un investimento specifico sul portafoglio di un cliente o potenziale cliente.

Tenuto conto dei rischi di natura economica, finanziaria e di sostenibilità e integrazione ESG, non può essere offerta alcuna garanzia che gli strumenti finanziari raggiungano i propri obiettivi d'investimento. Le performance possono variare in particolare in funzione degli obiettivi o delle strategie di investimento degli strumenti finanziari e di condizioni economiche e di mercato rilevanti, come i tassi di interesse. Le diverse strategie applicate agli strumenti finanziari possono avere un impatto significativo sui risultati presentati in questo documento. Le performance passate, ove illustrate, non sono garanzia di risultati futuri e il valore degli investimenti negli strumenti finanziari può, per sua natura, diminuire oltre che aumentare. È possibile che gli investitori non recuperino l'importo inizialmente investito.

I dati di performance, se presenti nel documento, non tengono conto dei costi, delle commissioni e degli oneri fiscali.

È possibile consultare la sintesi dei diritti degli investitori visitando il sito <https://www.bnpparibas-am.it/>. BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Italian branch si riserva la facoltà di cessare la commercializzazione degli organismi d'investimento collettivo del risparmio (OICR) nelle ipotesi previste dalla regolamentazione applicabile.

"The sustainable investor for a changing world" riflette l'obiettivo di BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Italian branch di includere lo sviluppo sostenibile nel quadro delle sue attività, anche se non tutti gli OICR soddisfano le previsioni indicate all'articolo 8, con una quota minima di investimenti sostenibili, o art. 9 del Regolamento Europeo 2019/2088 in merito all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (Sustainable Finance Disclosure Regulation SFDR). Puoi trovare maggiori informazioni visitando il sito www.bnpparibas-am.com/en/sustainability.

Disclaimer Morningstar:

Copyright © 2023 Morningstar, Inc. Tutti i diritti riservati. Il rating complessivo per ciascun comparto è basato sulla media ponderata del numero di stelle assegnate nei periodi di valutazione su tre, cinque e dieci anni. Le informazioni contenute in questo sito sono proprietà di Morningstar e dei suoi provider di contenuti e non possono essere copiate o distribuite. Non vi è garanzia che informazioni siano complete tempestive e accurate. Morningstar e i suoi provider di contenuti declinano ogni responsabilità per eventuali danni e perdite derivate dall'uso di queste informazioni. Le performance passate non vanno intese come garanzia degli andamenti futuri.

Index disclaimer

Il fondo non è sponsorizzato, avallato, venduto o promosso da msci inc. ("msci"), dalle sue affiliate, dai suoi fornitori di informazioni o da terze parti coinvolte nella - o in qualche modo legate alla- compilazione, calcolo o creazione di un indice msci (collettivamente le "parti msci"). Gli indici msci sono di proprietà esclusiva di msci. I nomi msci e indice msci sono marchi di servizio di msci o delle sue affiliate e sono stati concessi in uso per alcune finalità al BNP Paribas Asset Management. Le parti msci non rilasciano alcuna dichiarazione o garanzia, esplicita o implicita agli emittenti, ai possessori di questo fondo o ad altre persone o soggetti in relazione all'idoneità di un investimento in fondi in generale o in questo fondo in particolare, né sulla capacità di un indice msci di replicare la performance del mercato azionario corrispondente. msci o le sue affiliate sono i concessionari di licenza di alcuni marchi, marchi di servizio e nomi commerciali degli indici msci che sono determinati, composti e calcolati da msci senza alcun riguardo per questo



fondo, per l'emittente o per i possessori del fondo, né per altre persone o soggetti. nessuna delle parti msci ha alcun obbligo di tenere in considerazione le esigenze dell'emittente o dei possessori di questo fondo nel determinare, comporre o calcolare gli indici msci. le parti msci non sono responsabili dei tempi, dei prezzi o della quantità delle emissioni del fondo, non hanno partecipato alle relative decisioni, né al calcolo dell'equazione con cui, o del corrispettivo verso il quale questo fondo può essere riscattato

