



COMUNICATO

ai partecipanti ai Fondi BNL e al fondo comune d'investimento BNL Bond Euro Breve Termine

Gentile Cliente,

lo scopo della presente comunicazione, resa ai sensi della vigente normativa di riferimento, è quello di informarla in merito ad alcune novità che interessano la famiglia Fondi BNL ed in particolare il fondo BNL Bond Euro Breve Termine (il Fondo) a partire dal 1° aprile 2021.

Lo sviluppo sostenibile è al centro della strategia e delle decisioni d'investimento di BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France. Dal 2019, è stata implementata una strategia d'investimento sostenibile che si basa su quattro pilastri:

1. L'integrazione sistematica dei criteri ambientali, sociali e di governance (ESG) nel processo di Investimento;
2. Il voto, il dialogo e l'impegno con le imprese;
3. La condotta professionale responsabile: esclusioni settoriali e normative;
4. La visione prospettica: le 3E che corrispondono alla transizione energetica (Energie), alla tutela dell'ambiente (Environnement), all'uguaglianza (Egalité) e alla crescita inclusiva.

Il Regolamento UE 2019/2088 sulla pubblicazione delle informazioni in materia di sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (SFDR) impone alle società di gestione patrimoniale di fornire agli investitori informazioni in merito all'integrazione degli aspetti relativi allo sviluppo sostenibile nei portafogli degli organismi d'investimento collettivo che esse gestiscono.

In tale prospettiva, la documentazione regolamentare dei Fondi BNL è stata modificata al fine di tener conto di tali nuove esigenze e, in particolare, sono state adeguate le sezioni relative alla politica di investimento e al profilo di rischio del Prospetto informativo e del Regolamento di gestione.

L'aggiornamento della documentazione regolamentare non influisce in alcun modo sulle caratteristiche del Suo Fondo né sul Suo profilo di rischio/rendimento.

Il fondo BNL Bond Euro Breve Termine (in precedenza denominato BNL Bond Euro Cash Plus e BNL Liquidità e appartenente ai Fondi BNL) è stato, inoltre, interessato dalla seguente modifica.

Le ricordiamo, innanzi tutto, che il Fondo ha adottato dal 29 novembre 2013 una struttura master/feeder transfrontaliera, che prevede la concentrazione pari ad almeno l'85% degli investimenti del portafoglio del fondo in uno specifico OICR detto fondo master, rappresentato dal fondo di diritto francese BNP Paribas Bond 6M.



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

**L'asset manager
per un mondo
che cambia**

L'entrata in vigore del Regolamento UE 2016/1011 dell'8 giugno 2016, nuovo Regolamento UE sugli indici usati come benchmark in strumenti finanziari e contratti finanziari o per misurare la performance dei fondi di investimento, ha portato alla scomparsa programmata di alcuni indici, tra cui l'EONIA (Euro Overnight Index Average), utilizzato come benchmark del fondo master BNP Paribas Bond 6M.

Si è reso, pertanto, necessario procedere alla modifica del benchmark del fondo master da 80% EONIA (Euro Overnight Index Average) + 20% Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-3 anni (coupon reinvestiti) a 80% € STR capitalizzato (Euro Short Term Rate) + 20% Bloomberg Barclays Euro Aggregate 1-3 anni (coupon reinvestiti).

L'indice € STR capitalizzato (Euro Short Term Rate) è stato sviluppato dalla Banca Centrale Europea (BCE) al fine di sostituire l'EONIA (Euro Overnight Index Average).

Alla luce di quanto sopra, l'organo competente presso la succursale italiana di BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, nel corso della seduta tenutasi in data 31 marzo 2021 ha deliberato di recepire nel Regolamento di gestione del Fondo le modifiche connesse al recepimento del nuovo benchmark dell'OICR master BNP Paribas Bond 6M nel Fondo.

La informiamo altresì che, come previsto dal Provvedimento della Banca d'Italia del 19 gennaio 2015, come modificato dal Provvedimento del 23 dicembre 2016, le modifiche proposte si riflettono anche sul testo del Regolamento dei Fondi BNL, e che le stesse sono da intendersi approvate in via generale dalla Banca d'Italia in ottemperanza alle previsioni di cui al Titolo V, Capitolo II, Sezione III, Paragrafo 3 del suddetto Provvedimento e in conformità a quanto indicato dalla Banca d'Italia con circolare n. 1502937/18 del 21/12/2018.

Milano, 31 marzo 2021

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France – Milan Branch

Registro Imprese di Milano-Monza-Brianza-Lodi n° 10212140965 - C.F./P. IVA n° 10212140965 – C.C.I.A.A. di Milano n° REA MI – 2513607 Iscritta nell'elenco allegato all'Albo delle SGR di cui all'art. 35 del d.lgs. 58/98, alle sezioni società di gestione UE e gestori FIA UE -Piazza Lina Bo Bardi, 3 - 20124 Milano - Telefono (+39) 027247.1 - Fax (+39) 02 7247 5662 - Fax Ufficio Clienti (+39) 02 7247 5663 - www.bnpparibas-am.it BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France. – “Société par actions simplifiée” con capitale sociale 120.340.176€ - Sede sociale 1, Boulevard Haussmann – 75009 Parigi (Francia), 319 378 832 RCS Paris. Autorizzata all'esercizio di gestione collettiva del risparmio dall'Autorité des Marchés Financiers con provvedimento numero GP96002