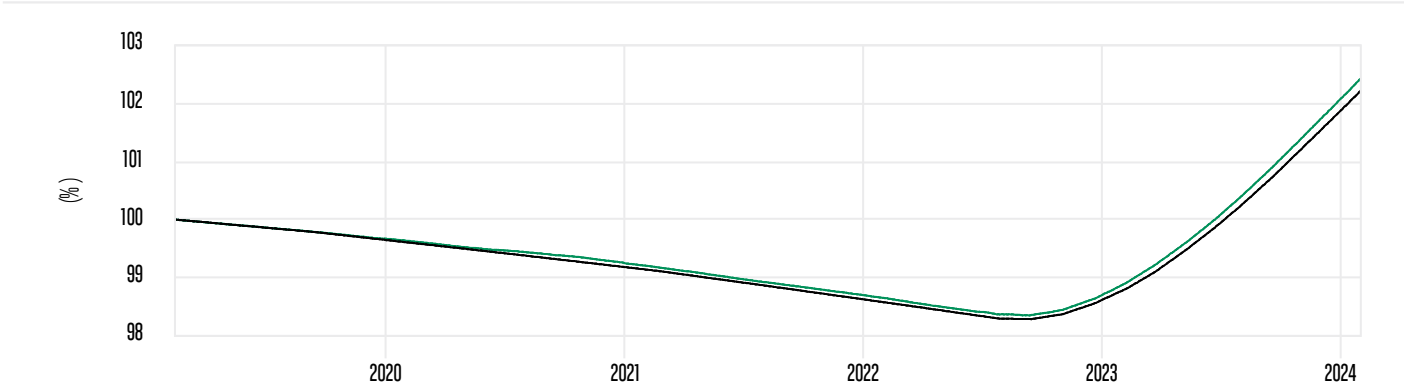


DASHBOARD AU 31.01.2024

Catégorie ESMA	Indice de référence	Nb de positions dans le portefeuille	Actif du compartiment (EUR mn.)
Monétaire Short term VNAV	Cash Index Euro Short Term Rate (EUR) RI 360 Days	164	6679
Niveau de risque et de rendement	Performance YTD (1)	Perf. annualisée sur 3 ans (2)	
1 2 3 4 5 6 7	0,38 % Indice de référence 0,37 %	1,05 % Indice de référence 1,01 %	

(1) Tous les chiffres sont nets de frais (en EUR).
(2) Basée sur 360 jours
Le Fonds est un fonds monétaire à valeur nette d'inventaire variable à court terme (ci-après un « FM ») tel que défini par le règlement (UE) 2017/1131 du Parlement européen et du Conseil du 14 juin 2017 sur les fonds monétaires (le « Règlement »).

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



Performances calendaires au 31.01.2024 (en %)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
FONDS	3,39	-0,01	-0,56	-0,42	-0,38	-0,40	-0,40	-0,20	0,00	0,20
INDICE DE RÉFÉRENCE	3,28	-0,03	-0,56	-0,47	-0,40	-0,40	-0,40	-0,30	-0,10	0,10

Performances mensuelles annualisées au 31.01.2024 (en %)

	01.2024	12.2023	11.2023	10.2023	09.2023	08.2023	07.2023	06.2023	05.2023	04.2023	03.2023	02.2023
FONDS	4,01	4,01	4,03	3,98	3,86	3,77	3,52	3,31	3,15	2,93	2,66	2,44
INDICE DE RÉFÉRENCE	3,91	3,91	3,91	3,91	3,73	3,64	3,41	3,22	3,06	2,90	2,52	2,25

(1) Tous les chiffres sont nets de frais (en EUR).
Un Fonds Monétaire (ci-après un "FM") n'est pas un produit garanti. Un investissement dans un FM diffère d'un placement dans des dépôts en ce qu'il comporte le risque de fluctuation du principal investi dans un FM. Le FM n'a recours à aucun prestataire externe pour garantir la liquidité des FM ou la stabilisation de la VL par action. Toute perte du principal est assumée par les actionnaires.
Les performances ou réalisations du passé ne sont pas indicatives des performances futures.
Source : BNP Paribas Asset Management



POSITIONS : % DU PORTEFEUILLE

Principales positions

BNPP INSC EUR 1D I C	3,04
ENGIE SA 16-APR-2024	1,80
ENGIE SA 15-FEB-2024	1,42
BARCLAYS BANK PLC 27-AUG-2024	1,14
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT 27-AUG-2024	1,14
CREDIT AGRICOLE SA 06-JAN-2025	1,13
MUFG BANK LTD (LONDON BRANCH)	1,11
SUMITOMO MITSUI BANKING CORP (BR	1,04
BPCE SA 04-JUN-2024	1,00
CA CONSUMER FINANCE SA 05-MAR-2024	0,90

Nb de positions dans le portefeuille **164**

Nous attirons votre attention sur le fait que nous pouvons investir plus de 5 % des actifs du fonds dans des administrations, institutions ou organismes qui émettent ou garantissent séparément ou conjointement des instruments du marché monétaire

par Maturité

1 jour	0,75
2 - 7 jours	3,64
8 - 30 jours	13,38
31 - 90 jours	28,39
91 - 180 jours	19,00
181 - 397 jours	19,19
Liquidités	15,65
Total	100,00

Prenant en compte la maturité réelle de l'instrument et non les exceptions potentielles décrites dans le règlement des fonds monétaires pour le calcul des actifs à échéance hebdomadaire.

par Notation

Notation court terme

A-1+	4,84
A-1	43,94
A-2	32,58
A-3	1,85
Non-investment grade	0,29

Not rated

Non noté	0,83
----------	------

OPCVM

OPCVM	3,04
-------	------

Cash, repos, IRS

Cash, repos, IRS	12,62
------------------	-------

Total **100,00**

Notation la plus basse parmi celles de Fitch, Moody's et S&P.

Source : BNP Paribas Asset Management, en date du 31.01.2024

Sources : Fitch, Moody's, S&P. Les notations < BBB- correspondent à la catégorie de titres à haut rendement ou titres spéculatifs

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.

par Type d'Instruments

Negotiable european commercial paper (neucp)	46,77
European commercial paper (ecp)	28,91
Liquidités	12,62
European (ex. uk) certificate of deposit	8,65
Fonds monétaires	3,04
swaps	0,01
Total	100,00



INFORMATIONS EXTRA-FINANCIÈRES

Score ESG global

59,06

Indice de référence : 53,39

CONTRIBUTION ESG

	Contrib. environnementale (E)	Contrib. sociale (S)	Contrib. gouvernance (G)
Portefeuille	5,09	3,00	0,96
Indice de référence	2,86	-0,29	0,82

COUVERTURE DU PORTEFEUILLE

	Couverture
Couverture ESG	99,73 %

Indice de référence ESG

Pour plus d'information sur la définition du benchmark ESG, veuillez-vous référer à la rubrique « stratégie d'investissement » du prospectus disponible à cette adresse : www.bnpparibasam.com

Score ESG global

La méthodologie interne de BNPP AM détermine le score ESG des émetteurs en évaluant leur performance par rapport aux entreprises du même groupe de pairs sur la base d'un nombre limité de critères ESG relatifs à l'environnement (ex: changement climatique), aux problématiques sociales (ex: gestion des ressources humaines), et à la gouvernance d'entreprise (ex: indépendance et compétence des dirigeants). L'univers d'investissement est scindé par géographie et par secteur, ce qui permet de composer des groupes d'entreprises comparables, dit « groupe de pairs ». BNPP AM utilise de nombreuses sources de recherche et de données (notamment Sustainalytics, ISS et Trucost) pour calculer les scores ESG des entreprises. Si les engagements et les pratiques de l'émetteur sur un des critères d'évaluation (E, S ou G) sont meilleurs que ceux de ses concurrents, il se voit attribuer une contribution positive sur ce critère. Un score de 1 à 99 est assigné à chaque émetteur, qui correspond à une base neutre de 50 à laquelle s'ajoute la somme des contributions sur chacun des trois critères d'évaluation. (par ex : 50 +2 (E) -1 (S) +3 (G) = 54 ESG global score).

Contribution ESG

Les contributions ESG sont déterminées par les analystes ESG de BNPP AM sur la base de critères détaillés permettant d'évaluer de façon systématique les engagements et les pratiques des entreprises en matière d'environnement, de social et de gouvernance. Chacune des contributions mentionnées pour le portefeuille ou l'indice de référence dans son ensemble est la moyenne pondérée des contributions des entreprises détenues en portefeuille ou entrant dans la composition de l'indice de Référence.

- La contribution environnementale (E) regroupe entre autres le rapport au changement climatique, la gestion du risque environnemental et l'utilisation des ressources naturelles.
- La contribution sociale (S) prend en compte entre autres la gestion des ressources humaines, la qualité du dialogue social et le respect de la diversité.
- La contribution de gouvernance (G) s'appuie entre autres sur la transparence sur la rémunération des dirigeants, la lutte contre la corruption et l'égalité homme femme.

Couverture du portefeuille

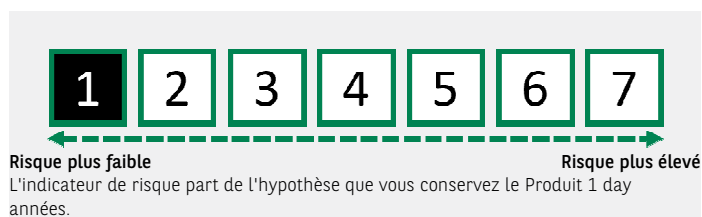
Au sein d'un portefeuille ou d'un indice de référence, BNPP AM statue tout d'abord sur l'éligibilité des instruments à obtenir des indicateurs ESG en fonction de leur nature. Au sein de ces instruments éligibles d'après la méthodologie interne de BNPP AM, la couverture représente le pourcentage de titres bénéficiant d'un score ESG ou d'une empreinte carbone. Les titres non éligibles à une évaluation comprennent, de manière non exhaustive, les liquidités, les fonds externes.

Pour plus d'info sur les indicateurs ESG ou sur les méthodologies de calcul des taux de couvertures veuillez-vous référer à notre page web dédiée: <https://www.bnpparibas-am.com/fr/dispositif-de-notation-esg/> & <https://www.bnpparibas-am.com/fr/mesure-de-lempreinte-carbone/>
 Pour plus d'informations sur nos documents de développement durable, veuillez consulter la page web de BNPP AM : <https://www.bnpparibas-am.com/fr/documentation-sustainability/>



RISQUE

Niveau de risque et de rendement



Analyse de risque

Fonds

Volatilité (sur 3 ans, mensuelle)	0,55
WAM (jours) (31.01.2024)	13
WAL (jours) (31.01.2024)	94

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 1 sur 7, qui est la classe de risque la plus basse.

L'investissement dans des instruments de type monétaire et obligations à court terme avec une volatilité très basse justifie la catégorie de risque.

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 crédit :** le risque que la solvabilité d'un émetteur se détériore ou qu'il fasse défaut, entraînant potentiellement une baisse de la valeur des instruments associés.

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

Frais d'entrée max.	0,50%
Frais de sortie max.	0,00%
Frais courants estimés (02.10.23)	0,12%
Commission de gestion max.	0,20%

Chiffres clés

VL	58 062,80
12M VL max. (31.01.24)	58 062,80
12M VL min. (01.02.23)	56 053,25
Actif du compartiment (EUR mn.)	6 678,95
Première VL	1 524,49
Périodicité de calcul de la VL	Journalière

Codes

Code ISIN	FR0010337667
Code Bloomberg	BNPCVSI FP

Caractéristiques

Forme juridique	FCP (Fonds commun de placement) BNP PARIBAS CASH INVEST de droit français
Investissement minimum	10 000 000 EUR
Éligible au PEA	Non
Indice de référence	Cash Index Euro Short Term Rate (EUR) RI 360 Days
Domiciliation	France
Date de lancement	17.03.1997
Gérant(s)	Gilles LEROY
Société de gestion	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France
Dépositaire	BNP PARIBAS
Devise de base	EUR
Catégorie AMF	2
Article SFDR	8



GLOSSAIRE

Sensibilité

Échelle de mesure de la sensibilité aux taux des obligations. Plus la durée résiduelle augmente, plus les cours obligataires réagissent à une modification des taux et plus la durée est élevée. La règle dit que si le taux remonte ou baisse de 1%, la valeur de l'obligation fluctue de 1% x la durée.

VLC (valeur liquidative constante) lié à la dette publique

Un fonds monétaire VLC lié à la dette publique est un type de fonds défini dans le Règlement de l'Union Européenne sur les fonds monétaires, qui fait partie de la catégorie des fonds monétaires à court terme. La souscription et le remboursement des parts du fonds sont effectués à un prix constant, arrondi au point de pourcentage le plus proche.

VLV (valeur liquidative à faible volatilité)

Un fonds monétaire VLV lié à la dette publique est un type de fonds défini dans le Règlement de l'Union Européenne sur les fonds monétaires, qui fait partie de la catégorie des fonds monétaires à court terme. La souscription et le remboursement des parts du fonds sont effectués à un prix constant, à condition que la valeur liquidative du fonds ne s'écarte pas de plus de 0,2% de la valeur nominale.

VLV (valeur liquidative variable)

Les fonds VLV sont des fonds monétaires dont les investisseurs peuvent acheter ou se faire rembourser les parts à un prix découlant d'une valeur liquidative variable, calculée avec une précision de 4 décimales. Ils peuvent faire partie de la catégorie des fonds monétaires à court terme ou des fonds monétaires standards.

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).

WAL (durée de vie moyenne pondérée)

La DVMP (durée de vie moyenne pondérée) d'un fonds monétaire est calculée de la même façon que la maturité moyenne pondérée (MMP), mais est fondée exclusivement sur les périodes restant à courir jusqu'à : (a) la date programmée de remboursement des titres détenus au portefeuille du fonds ou (b) leur date de remboursement à la demande du fonds, indépendamment de la date programmée de révision de leur taux d'intérêt.

WAM (échéance moyenne pondérée)

Dans le cas des fonds monétaires, la maturité moyenne pondérée (MMP) est la moyenne des périodes restant à courir jusqu'à : (a) la date programmée de remboursement des titres détenus au portefeuille du fonds, (b) leur date de remboursement à la demande du fonds, ou (c) la date programmée de révision de leur taux d'intérêt en fonction des taux en vigueur sur le marché. Les titres à taux variable remboursables sur demande sont traités comme si leur date d'échéance était la plus rapprochée de ces deux dates si leur maturité programmée est inférieure ou égale à 397 jours, et la plus éloignée si leur maturité programmée est supérieure à 397 jours. La moyenne est pondérée par le pourcentage du coût amorti du portefeuille investi au cours de chaque période.

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

DISCLAIMER

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France est une société de gestion de portefeuille agréée par l'Autorité des marchés financiers sous le n° GP96002, constituée sous forme de société par actions simplifiée, ayant son siège social au 1, boulevard Haussmann 75009 Paris, France, RCS Paris 319 378 832, et son site web : www.bnpparibas-am.com.

Le présent document a été rédigé et est publié par la société de gestion de portefeuille.

Ce contenu vous est communiqué à titre purement informatif et ne constitue :

1. ni une offre de vente, ni une sollicitation d'achat, et ne doit en aucun cas servir de base ou être pris en compte pour quelque contrat ou engagement que ce soit ;
2. ni un conseil d'investissement.

Le présent document se réfère à un ou plusieurs instruments financiers agréés et réglementés dans leur juridiction de constitution.

Aucune action n'a été entreprise qui permettrait l'offre publique de souscription des instruments financiers dans toute autre juridiction, excepté suivant les indications de la version la plus récente du prospectus des instruments financiers ou sur le site web (rubrique « nos fonds »), dans laquelle une telle action serait requise, en particulier, aux États-Unis, pour les ressortissants américains (ce terme est défini par le règlement S du United States Securities Act de 1933). Avant de souscrire dans un pays dans lequel les instruments financiers sont enregistrés, les investisseurs devraient vérifier les contraintes ou restrictions légales potentielles relatives à la souscription, l'achat, la possession ou la vente des instruments financiers en question. Il est conseillé aux investisseurs qui envisagent de souscrire des instruments financiers de lire attentivement la version la plus récente du prospectus et du document d'information clé (DIC) et de consulter les rapports financiers les plus récents des instruments financiers en question lorsque ceux-ci sont déjà disponibles.

Ces documents sont disponibles dans la langue du pays dans lequel l'organisme de placement collectif/instrument financier est autorisé à la commercialisation et /ou en anglais le cas échéant, sur le site suivant, rubrique « nos fonds » : www.bnpparibas-am.com.

Les opinions exprimées dans le présent document constituent le jugement de la société de gestion de portefeuille à la date de publication du document et sont susceptibles d'être modifiées sans préavis. La société de gestion de portefeuille n'a pas l'obligation de les tenir à jour ni de les modifier. Il est recommandé aux investisseurs de consulter leurs propres conseillers juridiques et fiscaux en fonction des considérations légales, fiscales, domiciliaires et comptables qui leur sont applicables avant d'investir dans les instruments financiers afin de déterminer eux-mêmes l'adéquation et les conséquences de leur investissement, pour autant que ceux-ci soient autorisés. À noter que différents types d'investissements, mentionnés le cas échéant dans le présent document, impliquent des degrés de risque variables et qu'aucune garantie ne peut être donnée quant à l'adéquation, la pertinence ou la rentabilité d'un investissement spécifique pour le portefeuille d'un client ou futur client.

Compte tenu des risques économiques et de marché, aucune garantie ne peut être donnée quant à la réalisation par les instruments financiers de leurs objectifs d'investissement. Les performances peuvent varier notamment en fonction des objectifs ou des stratégies d'investissement des instruments



financiers et des conditions économiques et de marché importantes, notamment les taux d'intérêt. Les différentes stratégies appliquées aux instruments financiers peuvent avoir un impact significatif sur les résultats présentés dans ce document. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et la valeur des investissements dans les instruments financiers est susceptible par nature de varier à la hausse comme à la baisse. Il se peut que les investisseurs ne récupèrent pas leur investissement initial.

Les données de performance, éventuellement présentées dans ce document, ne prennent en compte ni les commissions et frais contractés à l'émission ou au rachat de parts ni les taxes.

Vous pouvez obtenir, en cliquant ici : www.bnpparibas-am.fr/investisseur-professionnel/synthese-des-droits-des-investisseurs /un résumé des droits des investisseurs en français. BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT FRANCE peut décider de cesser la commercialisation des instruments financiers, dans les hypothèses visées par la réglementation applicable.

« L'investisseur durable d'un monde qui change » reflète l'objectif de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France d'inscrire le développement durable dans le cadre de ses activités, sans pour autant que tous les produits gérés par BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France ne relèvent de l'article 8, ayant une proportion minimale d'investissements durables, ou de l'article 9 du Règlement Européen 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR). Vous trouverez plus d'information sous le lien www.bnpparibas-am.com/en/sustainability

