

PERCENTUALE MEDIA WHITE LIST E ASSIMILATI DELLE SICAV DI DIRITTO LUSSEMBURGHESE DI BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT

II Semestre 2019



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

L'asset manager
per un mondo
che cambia



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

A tutti i soggetti interessati

Lussemburgo, 27 giugno 2019

OGGETTO: Identificazione percentuale titoli di stato e white list presenti nel portafoglio degli OICR ai fini dell'applicazione D.L. 13 agosto 2011 n. 138 convertito con modificazioni dalla L. 14 settembre 2011 n. 148.

In allegato vi trasmettiamo i prospetti riepilogativi contenenti l'indicazione delle percentuali necessarie per la determinazione della base imponibile di cui al D.L. in oggetto per gli OICR di diritto Lussemburghese gestiti dalla scrivente Società e relativi ai seguenti fondi/sicav:

- PARVEST
- BNP PARIBAS L1
- BNP PARIBAS PLAN
- BNP PARIBAS EASY
- PARWORLD
- BNPP Lussemburgo - Altri OICR di diritto lussemburghese

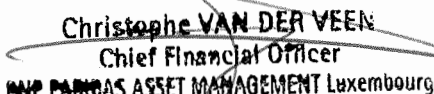
Le suddette percentuali sono state calcolate sulla base delle ultime due situazioni contabili semestrali/annuali disponibili dei singoli OICR e sono da utilizzare ai fini dell'applicazione del D.L. in oggetto nel periodo 1° luglio 2019/31 dicembre 2019.

Cordiali saluti,

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg S.A.


Stephane BRUNET
Chief Executive Officer
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg

Nome: S. BRUNET
Carica: C.E.O.


Christophe VAN DER VEEN
Chief Financial Officer
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg

Nome: C. VAN DER VEEN
Carica: Chief Financial Officer

| Nome del fondo | Data dell'ultimo rendiconto semestrale | Data dell'ultimo rendiconto annuale | PERCENTUALE MEDIA WHITE LIST E ASSIMILATI | DATA DI VALENZA DELLA PERCENTUALE | DATA DI FINE VALENZA DELLA PERCENTUALE |
|---|--|-------------------------------------|---|-----------------------------------|--|
| BNP PARIBAS A FUND European Multi-Asset Income | 28/09/2018 | 31/03/2019 | 10,78% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS COMFORT BOND FUND | 31/07/2018 | 31/01/2019 | 20,80% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS EASY BARCLAYS EURO GOVERNMENT INFLATION LINKED ALL MATURITIES | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 99,62% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS EASY ENERGY & METALS ENHANCED ROLL | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,20% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS EASY JPM EMBI GLOBAL DIVERSIFIED COMPOSITE | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 64,24% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS EASY JPM GBI EMU | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 97,92% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS EASY JPM GBI GLOBAL EX EMU HEDGED EUR | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 98,72% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS FLEXI I BOND GOVERNMENT EURO RESTRICTED | 30/06/2018 | 31/12/2018 | 92,59% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS FLEXI I BOND WORLD EMERGING INVESTMENT GRADE | 30/06/2018 | 31/12/2018 | 13,39% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |

| | | | | | |
|---|------------|------------|---------------|------------|------------|
| BNP PARIBAS FLEXI I US MORTGAGE | 30/06/2018 | 31/12/2018 | 2,41% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS FLEXI III EURO GOVERNMENT LONG-DATED PASSIVE BOND FUND | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 99,29% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS GLOBAL BOND FUND | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 48,04% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 BOND EURO CORPORATE | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,24% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 BOND EURO OPPORTUNITIES | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 44,94% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 BOND WORLD EMERGING LOCAL | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 80,93% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 BOND WORLD PLUS | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 26,22% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 CONVERTIBLE BOND WORLD | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,97% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 MULTI-ASSET INCOME | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 12,06% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 PATRIMOINE | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 11,77% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 SUSTAINABLE ACTIVE BALANCED | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 7,00% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |

| | | | | | |
|---|------------|------------|---------------|------------|------------|
| BNP PARIBAS L1 SUSTAINABLE ACTIVE GROWTH | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 4,56% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS L1 SUSTAINABLE ACTIVE STABILITY | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 25,53% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS MULTI FLEXIBLE INCOME | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,26% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2021 | 31/10/2018 | 30/04/2019 | 6,15% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2023 | 31/10/2018 | 30/04/2019 | 2,25% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2026 | 31/10/2018 | 30/04/2019 | 3,14% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2028 | 31/10/2018 | 30/04/2019 | 3,80% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNP PARIBAS PLAN INTERNATIONAL DERIVATIVES | 31/10/2018 | 30/04/2019 | 75,71% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNPP LDI SOLUTION Dur Mat 0-10 Y Euro P | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 80,50% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNPP LDI SOLUTION Dur Mat 10-20 Y Euro P | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 81,17% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNPP LDI SOLUTION Dur Mat 20-25 Eur P | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 95,28% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |

| | | | | | |
|--|------------|------------|---------------|------------|------------|
| BNPP LDI SOLUTION Dur Mat 25-35 Eur P | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 93,26% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNPP LDI SOLUTION Dur Mat 35-50 Eur P | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 91,51% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| BNPP LDI SOLUTION Dur Mat All Maturities | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 86,24% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| FLEXIFUND PRIVATE OPTIMISED MANAGEMENT | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 67,37% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND ABSOLUTE RETURN V350 | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 21,96% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND ABSOLUTE RETURN V700 | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 19,64% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND ASIA EX-JAPAN | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 32,61% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND BEST SELECTION WORLD EMERGING | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 55,13% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND EURO | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 61,08% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND EURO GOVERNMENT | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 74,04% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND EURO INFLATION-LINKED | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 96,92% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |

| | | | | | |
|-------------------------------------|------------|------------|---------------|------------|------------|
| PARVEST BOND EURO LONG TERM | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 94,07% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND EURO MEDIUM TERM | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 45,75% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND EURO SHORT TERM | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 46,69% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND RMB | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 51,40% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND USD | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 9,58% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND USD SHORT DURATION | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 38,34% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND WORLD | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 38,94% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND WORLD EMERGING | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 51,42% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND WORLD EMERGING LOCAL | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 74,77% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND WORLD INCOME | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,40% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST BOND WORLD INFLATION-LINKED | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 95,01% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |

| | | | | | |
|--|------------|------------|---------------|------------|------------|
| PARVEST CONVERTIBLE BOND EUROPE | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,58% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST CONVERTIBLE BOND WORLD | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,26% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST COVERED BOND EURO | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 3,03% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST CROSS ASSET ABSOLUTE RETURN | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,27% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST DIVERSIFIED DYNAMIC | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 3,37% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST ENHANCED CASH 6 MONTHS | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 6,15% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST FLEXIBLE BOND EURO | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 57,77% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST FLEXIBLE BOND EUROPE CORPORATE | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,37% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST GLOBAL EQUITY ABSOLUTE RETURN STRATEGY ("GEARS") | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 18,73% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST GREEN BOND | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 27,32% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST MULTI-ASSET INCOME EMERGING | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 36,13% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |

| | | | | | |
|---|------------|------------|---------------|------------|------------|
| PARVEST SUSTAINABLE BOND EURO | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 51,31% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,83% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARVEST SUSTAINABLE BOND WORLD CORPORATE | 29/06/2018 | 31/12/2018 | 0,90% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARWORLD CHAMPIONS - MONDO GENIUS & RELAX | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 41,84% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARWORLD CHAMPIONS - MONDO PMI | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 39,21% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARWORLD CHAMPIONS - MONDO PMI 2 | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 39,45% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARWORLD LYRA | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 1,17% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARWORLD MULTI-ASSET BOOSTER | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 70,51% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARWORLD TRACK EMU GOVERNMENT BOND 1-10 YEARS | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 98,56% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |
| PARWORLD TRACKER MACRO OPPORTUNITIES | 30/09/2018 | 31/03/2019 | 0,87% | 01/07/2019 | 31/12/2019 |