

DASHBOARD AU 31.01.2024

Classe d'actifs	Indice de référence	Nb de positions de l'indice de référence	Actif du compartiment (EUR mn.)
Actions	Indice de référence composé*	149	219
Niveau de risque et de rendement	Performance YTD (1)	Perf. annualisée sur 3 ans (2)	
<div style="display: flex; gap: 5px;"> 1 2 3 4 5 6 7 </div>	<p>-2,07 %</p> <p>Indice de référence -2,05 %</p>	<p>-0,26 %</p> <p>Indice de référence -0,04 %</p>	

* MSCI Europe Small Caps SRI S-Series PAB 5% Capped (NTR)* index (Bloomberg: MXEUSSNE Index)

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

(2) Basée sur 360 jours

DESCRIPTION DE L'INDICE DE RÉFÉRENCE :

L'Indice est composé de sociétés européennes de petite capitalisation sélectionnées sur la base de critères environnementaux, sociaux et de gouvernance d'entreprise (ESG) minimaux (opportunités environnementales, pollution et déchets, capital humain, gouvernance d'entreprise, etc.) et sur la base de leurs efforts pour réduire leur exposition au charbon et aux combustibles fossiles non conventionnels. Il met en œuvre un plafond qui limite la pondération maximum d'une entreprise dans l'Indice à 5 % à chaque date de rééquilibrage. L'indice vise également à se conformer aux objectifs du Paris Aligned Benchmark (PAB) visant à réduire l'intensité carbone d'au moins 50 % par rapport à l'univers d'investissement initial et à atteindre un objectif de décarbonisation supplémentaire de 7 % par an. Par conséquent, les sociétés ayant commis d'importantes violations des principes du Pacte mondial des Nations unies et les sociétés impliquées dans de graves controverses liées aux critères ESG sont exclues de l'Indice. Le type d'approche utilisé ici est « Best-in-Class » (l'approche Best-in-Class identifie les leaders dans chaque secteur en fonction des meilleures pratiques ESG, tout en évitant ceux qui présentent des niveaux de risque élevés et qui ne respectent pas les normes ESG minimales selon l'administrateur de l'Indice et ses partenaires spécialisés). La stratégie extra-financière de l'Indice, menée à chaque étape du processus d'investissement, peut comprendre des limites méthodologiques telles que le risque lié à l'investissement ESG ou au rééquilibrage de l'Indice. De plus amples informations sur l'Indice, sa composition, son calcul et les règles de contrôle et de rééquilibrage périodiques, ainsi que sur la méthodologie générale commune à tous les indices MSCI, figurent sur le site Internet www.msci.com.

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



Performances cumulées au 31.01.2024 (en %)

	YTD	1 mois	3 mois	6 mois	1 an	2 ans	3 ans	4 ans	5 ans
● FONDS	-2,07	-2,07	16,00	1,17	1,58	-11,15	-0,79	4,19	23,60
● INDICE DE RÉFÉRENCE	-2,05	-2,05	16,04	1,36	1,82	-10,67	-0,13	4,89	24,30

Performances calendaires au 31.01.2024 (en %)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
● FONDS	10,29	-22,82	18,38	3,79	31,55	-15,60	19,20	1,00	24,00	6,90
● INDICE DE RÉFÉRENCE	10,54	-22,59	18,53	3,75	31,44	-15,80	18,80	0,50	24,70	6,40



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

12/2010-02/2016 : À la suite d'une opération sur titres le 19/02/2016, les performances indiquées correspondent à la simulation des performances passées et des frais du PARWORLD TRACK EUROPE SMALL CAP.

10/2015-04/2020 : Au cours de cette période, l'indice de référence était le « MSCI Europe Small Caps ex Controversial Weapons NTR » et la dénomination du Fonds était « MSCI EUROPE SMALL CAPS EX CW »

04/2020 - 12/2021: Au cours de cette période, l'indice de référence était Le MSCI Europe Small Caps SRI S-Series 5% Capped (NTR).



POSITIONS DE L'INDICE DE RÉFÉRENCE : (en %)

Principales positions

BANCA MEDIOLANUM	2,21
GALENICA AG	2,04
INTERMEDIATE CAPITAL GROUP PLC	1,97
HOWDEN JOINERY GROUP PLC	1,74
CONVATEC GROUP PLC	1,68
DIPLOMA PLC	1,67
STOREBRAND	1,56
BAWAG GROUP AG	1,55
PSP SWISS PROPERTY AG N	1,54
OSTERREICHISCHE POST AG	1,45
Nb de positions dans l'indice de référence	149

par Pays (indice de référence)

Royaume-Uni	27,82
Suède	11,18
Allemagne	9,21
Suisse	8,92
France	7,84
Italie	6,54
Norvège	3,84
Pays-Bas	2,65
Finlande	2,46
Autriche	2,23
Autres	17,29
Liquidités	0,01
Total	100,00

par Secteur (indice de référence) (%)

Industrie	25,02
Finance	14,98
Consommation discrétionnaire	10,90
Immobilier	9,38
Technologie de l'information	8,85
Matériaux	7,26
Santé	7,21
Services de communication	5,18
Consommation de base	4,78
Services publics	2,45
Autres	3,99
Liquidités	0,01
Total	100,00

Source : BNP Paribas Asset Management, en date du 31.01.2024

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



Analyse de risque (sur 3 ans, mensuelle)

	Fonds
Volatilité	18,79
Tracking Error	0,11

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 catégorie de risque se justifie par l'investissement effectué principalement dans des Actions, dont la valeur peut fluctuer considérablement. Ces fluctuations sont souvent amplifiées à court terme.

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 contrepartie:** ce risque est associé à la capacité d'une contrepartie à une transaction financière de gré à gré d'honorer ses engagements comme le paiement, la livraison et le remboursement.
- **Risque opérationnel:** en cas de défaillance opérationnelle au sein de la société de gestion, de l'un de ses agents ou du dépositaire, les investisseurs pourraient subir diverses perturbations (retard de paiement, de livraison...).

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.	3,00%
Frais de sortie max. (12.12.23)	3,00%
Commission de conversion max.	0,00%
Frais courants réels (31.12.22)	0,25%
Commission de gestion max.	0,13%

Données de l'indice au 31.01.2024

Nom	MSCI Europe Small Caps SRI S-Series PAB 5% Capped (NTR)* index (Bloomberg: MXEUSNE Index)
Code Bloomberg	MXEUSNE
Code Reuters	.MIEUF00msNEU

Codes

Code ISIN	LU1291101555
-----------	--------------

Places de quotation	Code Bloomberg	Code Reuters
iNAV	IEESM index	N/A
Euronext Paris	EESM FP	EESM.PA
Xetra	EESM GY	EESM.DE

Chiffres clés

VL	264,62
Actif du compartiment (Euro mn.)	219,07

Caractéristiques

Forme juridique	Compartiment de SICAV BNP PARIBAS EASY de droit Luxembourgeois
Durée d'investissement recommandée	5
Éligible au PEA	Non
Indice de référence	MSCI Europe Small Caps SRI S-Series PAB 5% Capped (NTR)* index (Bloomberg: MXEUSNE Index)
Domiciliation	Luxembourg
Date de lancement	19.02.2016
Gérant(s)	Alexandre ZAMORA
Société de gestion	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg
Gérant délégué	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France
Dépositaire	BNP PARIBAS, Luxembourg Branch



Caractéristiques

Devise de base	EUR
Exécution/Type de cours	VL + 1
Catégorie AMF	1 - Approche significativement engageante
Article SFDR	Article 8 – Promotion de caractéristiques environnementales ou sociales



GLOSSAIRE

Tracking Error

La tracking error mesure la volatilité du rendement relatif d'un portefeuille par rapport à son indice de référence.

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

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

Index disclaimer

Ce fonds n'est pas parrainé, validé, vendu ou promu par MSCI inc. ("MSCI"), ses sociétés liées, ses fournisseurs de données ou tout autre tiers impliqué dans la collecte, le calcul ou la création de tout indice MSCI (designés collectivement, les "parties MSCI"). Les indices MSCI sont la propriété exclusive de MSCI. MSCI et les noms des indices MSCI sont des marques de service de MSCI ou de ses sociétés liées et ont été autorisés à être utilisés à certaines fins par BNP Paribas Asset Management. Aucune des parties MSCI n'émet quelconque affirmation ou garantie, explicite ou implicite, à l'émetteur ou aux propriétaires de ce fonds ou à toute autre personne ou entité concernant la pertinence d'investir dans des fonds en général ou dans ce fonds en particulier ou concernant la capacité de tout indice MSCI à suivre la performance des marchés d'actions. MSCI ou ses sociétés liées sont les donneurs de licence de certaines marques commerciales et marques de service des indices MSCI qui sont déterminés, composés et calculés par MSCI sans rapport avec ce fonds ou l'émetteur ou les propriétaires de ce fonds ou toute autre personne ou entité. Aucune des parties MSCI n'a l'obligation de tenir compte des besoins de l'émetteur ou des propriétaires de ce fonds ou de toute autre personne ou entité pour déterminer, composer ou calculer les indices MSCI. Aucune des parties MSCI ne peut être tenue pour responsable de ni ne participe à la détermination du timing, des prix ou des quantités de ce fonds à émettre ou à la détermination ou au calcul de l'équation ou des conditions selon lesquelles ce fonds est remboursable.

