## DASHBOARD AU 30.10.2026

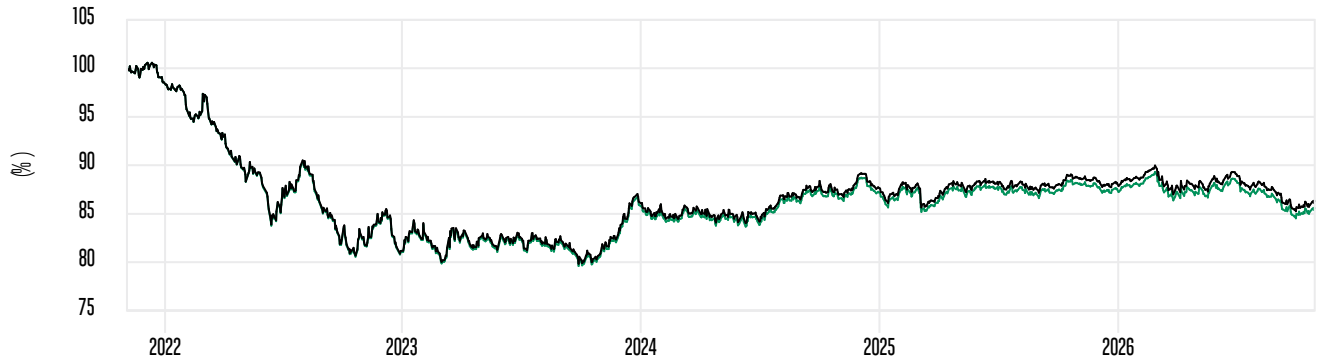
| Classe d'actifs | Indice de référence officiel | Nb de positions de l'indice de référence | Actif du compartiment (EUR mn.) |
|---|---|---|---|
| Produits de taux | J.P. Morgan Tilted EMU Government Bond IG (EUR) RI | 491 | 3687 |

| Devise de gestion | Indice de comparaison | Article SFDR | MSCI ESG Fund Rating |
|---|---|---|---|
| EUR | JP Morgan GBI EMU Unhedged Loc (EUR) RI | 8 | A |

## DESCRIPTION DE L'INDICE DE RÉFÉRENCE :

L'indice de référence est l'indice Bloomberg-Barclays Euro Aggregate Treasury (TR) publié en EUR par BLOOMBERG INDEX SERVICES LIMITED. La majorité des composants sous-jacents de l'indice sont des obligations d'État de la zone euro. L'indice Bloomberg Barclays Euro Treasury est composé d'obligations publiques, investment grade, à taux fixe, des pays souverains ayant des échéances supérieures à un an et d'un montant minimal de 300 millions d'euros. L'indice de comparaison est JP Morgan GBI EMU Unhedged Loc (EUR) RI

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




**Performances cumulées** au 30.10.2026 (en %)

| | YTD | 1 mois | 3 mois | 6 mois | 1 an | 2 ans | 3 ans | 4 ans | 5 ans |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FONDS | -2,28 | 0,93 | -1,72 | -1,96 | -2,93 | -1,14 | 6,16 | 3,93 | -13,11 |
| INDICE DE RÉFÉRENCE | -2,14 | 0,94 | -1,69 | -1,88 | -2,77 | -0,80 | 6,70 | 4,65 | -12,37 |
| INDICE DE COMPARAISON | -2,19 | 0,91 | -1,75 | -1,92 | -2,79 | -0,73 | 6,88 | 4,86 | -11,86 |

**Performances calendaires** au 30.10.2026 (en %)

| | 2025 | 2024 | 2023 | 2022 | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| FONDS | 0,42 | 1,50 | 6,00 | -17,80 | -3,60 | 4,90 | 6,70 | 0,70 | -0,02 | - |
| INDICE DE RÉFÉRENCE | 0,59 | 1,66 | 6,26 | -17,68 | -3,45 | 4,98 | 6,86 | 1,00 | 0,07 | - |
| INDICE DE COMPARAISON | 0,71 | 1,78 | 6,25 | -17,37 | -3,50 | 5,10 | 6,94 | 1,00 | - | - |

(1) Tous les chiffres sont nets de frais (en EUR). Les performances ou réalisations du passé ne sont pas indicatives des performances futures.
05/2017-09/2019 : Au cours de cette période, l'indice de référence était le JPM GBI EMU (TR).
09/2019-05/2022 : Au cours de cette période, l'indice de référence était le Bloomberg-Barclays Euro Aggregate Treasury (TR).
Source : BNP Paribas Asset Management
Toutes les données et performances s'appliquent à cette date, sauf indication contraire.
Pour de plus amples informations, en particulier sur les risques du produit, veuillez consulter le prospectus et le DICI du fonds.

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

| par Devise (%) | | Par rapport à l'indice Comparaison |
|---|---|---|
| EUR | 100,00 | - 0,00 |
| Autres | - | - 0,00 |
| **Total** | **100,00** | |

| par Pays (%) | | Par rapport à l'indice Comparaison |
|---|---|---|
| France | 22,04 | - 1,63 |
| Italie | 20,15 | - 1,52 |
| Allemagne | 21,26 | + 1,31 |
| Espagne | 15,24 | + 0,75 |
| Belgique | 5,40 | + 0,33 |
| Pays-Bas | 4,67 | + 0,30 |
| Autriche | 3,84 | + 0,24 |
| Portugal | 2,07 | + 0,12 |
| Finlande | 1,96 | + 0,11 |
| République d'Irlande | 1,50 | + 0,10 |
| Liquidités | - | - 0,00 |
| Autres | 1,87 | - 0,10 |
| **Total** | **100,00** | |

| par Notation | | Par rapport à l'indice Comparaison |
|---|---|---|
| AAA | 25,85 | + 1,60 |
| AA+ | 5,77 | + 0,34 |
| AA | 1,52 | + 0,10 |
| A+ | 29,87 | - 1,16 |
| A | 15,24 | + 0,75 |
| A- | 0,69 | - 0,05 |
| BBB+ | 19,96 | - 1,50 |
| BBB | 0,83 | - 0,07 |
| Autres | - | - 0,00 |
| Non noté | 0,27 | - 0,01 |
| Liquidités | - | - 0,00 |
| **Total** | **100,00** | |

| Répartition par maturité (%) | | Par rapport à l'indice Comparaison |
|---|---|---|
| < 1 an | 4,98 | + 0,02 |
| 1 - 3 ans | 20,73 | - 0,03 |
| 3 - 5 ans | 18,80 | - 0,07 |
| 5 - 7 ans | 13,09 | - 0,10 |
| 7 - 10 ans | 17,02 | - 0,05 |
| 10 - 15 ans | 10,53 | + 0,04 |
| > 15 ans | 14,85 | + 0,19 |
| Autres | - | - 0,00 |
| OPCVM | - | - 0,00 |
| Liquidités | - | - 0,00 |
| **Total** | **100,00** | |

Source : BNP Paribas Asset Management, en date du 30.10.2026.
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.

**Score ESG global**
**57,47**

## BNPPAM INFORMATIONS EXTRA-FINANCIÈRES

### CONTRIBUTION ESG

| | Contrib. environnementale (E) | Contrib. sociale (S) | Contrib. gouvernance (G) |
|---|---|---|---|
| Portefeuille | 5,11 | 3,62 | -1,26 |

### COUVERTURE DU PORTEFEUILLE

| | Couverture |
|---|---|
| Couverture ESG | 100,00 % |

## Caractéristiques de durabilité MSCI (TELLES QUE DISPONIBLES SUR LE SITE MSCI À LA FIN DE MOIS PRÉCÉDENT)

| | | | |
|---|---|---|---|
| MSCI ESG Fund Rating | A | | |
| MSCI Weighted Average Carbon Intensity (tonnes de CO2e/$M CA) | - | Couverture MSCI Weighted Average Carbon Intensity | 0% |
| MSCI ESG Quality Score (0-10) | 6.3 | | |

### 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, les performances 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

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 internalmethodology which can be lower than the full coverage offered per the index provider

### MSCI ESG Fund Rating

La notation ESG de MSCI est calculée comme une cartographie directe des scores de qualité ESG aux catégories de notation par lettre (par exemple AAA = 8,6-10). Les notations ESG vont du leader (AAAAA), de la moyenne (A, BBB, BB) à la traîne (B, CCC).

### MSCI Weighted Average Carbon Intensity

Il mesure l'exposition d'un fonds à des entreprises carbo-intensives. Ce chiffre représente l'estimation des émissions de gaz à effet de serre par tranche de 1 million de $ de chiffre d'affaires sur l'ensemble des positions du fonds. Cela permet des comparaisons entre fonds de différentes tailles.

### Couverture MSCI Weighted Average Carbon Intensity

C'est le pourcentage des positions du fonds pour lequel les données de MSCI Carbon Intensité sont disponibles. La mesure d'intensité carbone moyenne pondérée de MSCI est affichée pour les fonds couverts. Les fonds à faible couverture peuvent ne pas représenter pleinement les caractéristiques carbone du fonds en raison du manque de couverture.

### MSCI ESG Quality Score (0-10)

Le score de qualité ESG MSCI (0-10) pour les fonds est calculé à l'aide de la moyenne pondérée des notes ESG des positions des fonds. Le Score prend également en compte l'évolution des notations ESG des positions et l'exposition du fonds aux positions de la catégorie "laggard". MSCI évalue les positions sous-jacentes en fonction de leur exposition aux risques ESG spécifiques au secteur et de leur capacité à gérer ces risques par rapport à leurs pairs.

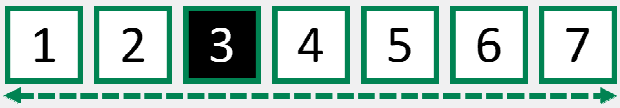
Pour plus d'info sur les indicateurs ESG ou sur les méthodologies de calcul des taux de couvertures veuillez-vous référer à notre page web dédiée: https://www.bnpparibas-am.com/fr/dispositif-de-notation-esg/ & https://www.bnpparibas-am.com/fr/mesure-de-lempreinte-carbone/
Pour plus d'informations sur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

## Label(s)

Le fonds a reçu la reconnaissance de l'Agence de labellisation Towards Sustainability (CLA) belge, qui lui a octroyé le label Towards Sustainability.
Ce label aide tous types d'investisseurs de détail et institutionnels à rechercher des solutions d'investissement et d'épargne plus durables, ce qui, en retour, encourage les institutions financières à proposer une gamme de produits durables diversifiée et de qualité.
Pour plus d'informations sur le label, consultez le site Web suivant : www.towardssustainability.be

## RISQUE

**Niveau de risque et de rendement**




**Risque plus faible** **Risque plus élevé**

L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit 3 années. Vous risquez de ne pas pouvoir vendre facilement votre Produit, ou de devoir le vendre à un prix qui influera sensiblement sur le montant que vous percevrez en retour.

| **Analyse de risque** (1 an, hebdomadaire) | **Fonds** |
|---|---|
| Volatilité | 3,85 |
| Tracking Error | 0,02 |
| Tracking Error Indice officiel de référence / comparaison | 0,07 |
| Sensibilité (30.10.2026) | 6,39 |
| YTM (rendement actuariel) (30.10.2026) | 3,81 |
| Coupon moyen | 2,44 |
| Duration | 6,50 |

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 3 sur 7, qui est une classe de risque entre basse et moyenne.
La catégorie de risque se justifie par l'investissement effectué principalement dans des instruments de Taux d'intérêt. L'attention de l'investisseur est attirée sur le fait qu'une hausse des taux d'intérêt a pour conséquence une diminution de la valeur des investissements en obligations et titres de créance et, plus généralement, des instruments à revenu fixe.

**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.
- **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. (31.10.26) | 3,00% |
| Frais courants réels (31.12.25) | 0,15% |
| Commission de gestion max. | 0,03% |

| **Données de l'indice au 31.10.2026** | |
|---|---|
| Nom | J.P. Morgan Tilted EMU Government Bond IG (EUR) RI |
| Code Bloomberg | LEATTREU |
| Code Reuters | .BCEATSY |

| **Codes** | |
|---|---|
| Code ISIN | LU1481202692 |
| Code Bloomberg | JBEM FP |

| **Places de quotation** | **Code Bloomberg** | **Code Reuters** |
|---|---|---|
| iNAV | IJBEM | INJBEMINAV.PA |
| Euronext Paris | JBEM FP | N/A |
| Swiss Exchange | JBEM SE | N/A |
| Borsa Italiana | JBEM IM | N/A |

| **Chiffres clés** | |
|---|---|
| VL | 9,27 |
| Actif du compartiment (Euro mn.) | 3 687,13 |

**Caractéristiques**

| | |
|---|---|
| Forme juridique | Compartiment de SICAV BNP PARIBAS EASY de droit Luxembourgeois |
| Durée d'investissement recommandée | 3 années |
| Éligible au PEA | Non |
| Indice de référence | J.P. Morgan Tilted EMU Government Bond IG (EUR) RI |
| Domiciliation | Luxembourg |
| Date de première VL | 31.05.2017 |
| Gérant(s) | Mohamed Fadil HANNANE |

**Caractéristiques**

| | |
|---|---|
| Société de gestion | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg |
| Gérant délégué | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe |
| Dépositaire | BNP PARIBAS, Luxembourg Branch |
| Devise de base | EUR |
| Exécution/Type de cours | VL + 1 |
| Catégorie AMF | 2 - Approche non 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 Europe 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 Europe peut décider de cesser la commercialisation des instruments financiers, dans les hypothèses visées par la réglementation applicable.

**Index disclaimer**

BLOOMBERG® est une marque commerciale ou de service de Bloomberg Finance L.P. et de ses filiales (désignés conjointement par le terme «~ »). BARCLAYS® est une marque commerciale ou de service de Barclays Bank Plc (désignés conjointement avec ses filiales par le terme «~ »), et est utilisée

sous licence. Bloomberg ou ses concédants, y compris Barclays, possèdent tous les droits de propriété sur les indices Bloomberg Barclays. Bloomberg et Barclays ne sont pas des filiales de BNP Asset Management, et elles n'approuvent pas, ne cautionnent pas, ne révisent pas et ne recommandent pas le produit autorisé. Ni Bloomberg ni Barclays ne garantissent l'opportunité, l'exactitude ou l'exhaustivité des données ou des informations concernant les indices Bloomberg Barclays et aucune des deux ne saurait être tenue pour responsable en aucune façon envers l'émetteur ou le producteur, les personnes investissant dans le produit autorisé ou d'autres tierces personnes en lien avec l'utilisation ou l'exactitude des indices Bloomberg Barclays ou des données qu'ils pourraient contenir.