

DASHBOARD AL 28.03.2024

Classi di attivo	Indice di Riferimento	Posizioni del benchmark	Patrimonio del fondo (USD mln)
Azioni	Benchmark Composito*	124	2.222

Profilo di Rischio e di Rendimento	Performance YTD (1)	Performance Annualizzate - 3 anni (2)
1 2 3 4 5 6 7	8,18% Indice di Riferimento 8,25%	11,99% Indice di Riferimento 12,30%

* MSCI USA SRI S-Series PAB 5% Capped (NTR) index (Bloomberg: M1CXUSC index)
(2) Basato su 365 giorni

DESCRIZIONE DELL'INDICE:

L'Indice è costituito da società statunitensi selezionate sulla base di criteri ambientale, sociale e di governance (ESG) (opportunità ambientali, inquinamento e rifiuti, capitale umano, governo societario, ecc.) minimi nonché sui relativi sforzi per ridurre la rispettiva esposizione al carbone e ai combustibili fossili non convenzionali. Implementa un limite massimo che circonda il peso massimo di una società all'interno dell'Indice al 5% a ogni data di ribilanciamento. Inoltre, l'indice mira a rispettare gli obiettivi del Paris Aligned Benchmark (PAB) di ridurre la concentrazione di carbonio di almeno il 50% rispetto all'universo d'investimento iniziale e di conseguire un ulteriore obiettivo di riduzione delle emissioni di carbonio del 7% ogni anno. Di conseguenza, sono escluse dall'Indice le società operanti in settori con ripercussioni negative potenzialmente elevate sui criteri ESG, quelle cui sono associate violazioni significative dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite e quelle coinvolte in gravi controversie correlate ai suddetti criteri. Il tipo di approccio qui impiegato è "Best-in-class" (ossia un approccio che identifica i leader in ogni settore sulla base delle migliori prassi ESG, evitando quelli che presentano elevati livelli di rischio e non rispettano gli standard ESG minimi, secondo l'amministratore dell'indice e i suoi partner specializzati). La strategia extrafinanziaria dell'Indice, realizzata in ogni fase del processo d'investimento, può comprendere limiti metodologici quali il rischio relativo agli investimenti ESG o al ribilanciamento dell'Indice. Ulteriori informazioni sull'Indice, la composizione, il calcolo e le regole dell'indice stesso ai fini di analisi e ribilanciamento periodici, così come sulla metodologia generale alla base degli indici MSCI, sono reperibili sul sito internet: www.msci.com.

PERFORMANCE (CUMULATE SU 5 ANNI) (EUR)



Performance Cumulata al 28.03.2024 (in %)

	YTD	1 Mese	3 Mesi	6 Mesi	1 Anni	2 Anni	3 Anni	4 Anni	5 Anni
FONDO	8,18	2,33	8,18	17,54	22,22	14,95	40,33	111,66	107,02
INDICE DI RIFERIMENTO	8,25	2,36	8,25	17,69	22,52	15,59	41,48	113,84	108,72

Performance dell'Anno Solare al 28.03.2024 (in %)

	2023	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014
FONDO	18,79	-15,90	42,19	17,36	32,94	0,40	-	-	-	-
INDICE DI RIFERIMENTO	19,09	-15,66	42,63	17,04	33,32	0,80	-	-	-	-

(1) Performance al netto delle commissioni (in EUR in UCITS ETF EUR, Distribuzione). Le performance e i risultati passati non sono indicativi dei rendimenti attuali o futuri. I dati sulla performance sono riportati al netto delle commissioni di gestione.

10/2017-09/2019: Nel corso di questo periodo, l'indice di riferimento è stato "MSCI KLD 400 Social (NTR)" e la denominazione dei Fondi era "MSCI KLD 400 US SRI"
09/2019 - 12/2021: Nel corso di questo periodo, l'indice di riferimento è stato MSCI USA SRI S-Series 5% Capped (NTR).

Fonte: BNP Paribas Asset Management

Per una descrizione e una definizione complete dei rischi, si prega di consultare l'ultimo prospetto informativo disponibile e i KIID dei fondi.



BENCHMARK POSIZIONI: (in %)

Principali Posizioni (%)

TEXAS INSTRUMENT INC	5,12
MICROSOFT CORP	5,02
NXP SEMICONDUCTORS NV	2,80
LAM RESEARCH CORP	2,80
INTUIT INC	2,62
PROLOGIS REIT INC REIT	2,58
AUTODESK INC	2,36
ADOBE INC	2,04
WELLTOWER INC REIT	1,73
GENERAL MILLS INC	1,72
N.ro Principali Posizioni del Benchmark	124

per Settore (benchmark) (%)

Tecnologia	24,40
Finanziari	18,02
Salute	17,41
Industriali	14,16
Consumi discrezionali	7,16
Immobiliare	6,71
Comunicazioni	3,89
Beni di prima necessità	3,51
Materiali	2,99
Utilities	1,75
Totale	100,00

Fonte: BNP Paribas Asset Management, al 28.03.2024

Titoli menzionati a mero scopo illustrativo. Non si intende sollecitare all'acquisto, né fornire raccomandazioni o consulenza all'investimento.

I dati riportati nelle factsheet si basano su dati contabili ufficiali e si riferiscono alla data di negoziazione.



INDICATORI EXTRA FINANZIARI

Bench. punteggio totale ESG
53,71

CONTRIBUTI ESG

	Contributo 'Ambientale'	Contributo 'Sociale'	Contributo 'Governance'
Benchmark	2,26	1,37	0,08

IMPRONTA CARBONIO

	T/Co2 per M€ all'anno
Benchmark	43,36

COPERTURA DI PORTAFOGLIO

	Copertura
Copertura ESG	99,00%
Impronta Carbonio copertura	99,00%

Indice di Riferimento ESG

Per maggiori informazioni sulla definizione di Benchmark ESG, fare riferimento alla sezione "Politica di investimento" del prospetto del Fondo, disponibile al seguente indirizzo: www.bnpparibasam.com

Punteggio totale di copertura ESG

La metodologia interna di BNPP AM determina il punteggio ESG degli emittenti valutando la loro performance rispetto a società pari (peer group) sulla base di un numero limitato di criteri ESG relativi all'ambiente (es. cambiamento climatico) e alle problematiche sociali (es. gestione delle risorse umane) e corporate governance (es. indipendenza e competenza dei dirigenti). L'universo di investimento è suddiviso per area geografica e per settore, il che consente di comporre gruppi di società comparabili (peer group). BNPP AM utilizza molte ricerche e fonti di dati (tra cui Sustainalytics, ISS e Trucost) per calcolare i punteggi ESG per le aziende. Se gli impegni e le pratiche dell'emittente su uno dei criteri di valutazione (E, S o G) sono migliori di quelli dei suoi concorrenti, gli viene assegnato un contributo positivo su tale criterio. Ad ogni emittente viene assegnato un punteggio da 1 a 99, che corrisponde ad una base neutra di 50 a cui si aggiunge la somma dei contributi su ciascuno dei tre criteri di valutazione. (es: 50 +2 (E) -1 (S) +3 (G) = 54 punteggio globale ESG).

Contributi ESG

I contributi ESG sono determinati dagli analisti ESG di BNP Paribas Asset Management sulla base di criteri dettagliati per valutare sistematicamente gli impegni e le pratiche delle aziende in ambito ambientale, sociale e governance. Ciascuno dei contributi di cui sopra, è la media ponderata dei contributi delle singole partecipazioni in portafoglio. Il contributo ambientale (E) tiene conto, tra le altre cose, del cambiamento climatico, della gestione del rischio ambientale e dell'uso delle risorse naturali. Il contributo sociale (S) tiene conto, tra le altre cose, della gestione del capitale umano, della qualità del dialogo sociale e del rispetto della diversità. Il contributo della governance (G) tiene conto, tra le altre cose, della trasparenza sulla remunerazione dei dirigenti, della lotta alla corruzione e dell'uguaglianza di genere.

Impronta Carbonio

L'impronta carbonio del fondo è data dalla somma delle componenti dell'indice cioè dalle emissioni di carbonio delle società divisa per l'Enterprise Value (EV) delle società moltiplicato per il peso delle società dell'indice replicato dal fondo. Le emissioni di carbonio sono la somma delle emissioni di Ambito 1 (emissione diretta dagli stabilimenti dell'azienda) e delle emissioni di Ambito 2 (emissioni indirette legate al consumo di energia dell'azienda). Il fornitore di dati sul carbonio è Trucost. L'impronta è espressa in tonnellate di CO2 equivalente all'anno e per milione di euro investito. L'Enterprise Value (EV) è la misura del valore totale di un'azienda. Si calcola sommando la capitalizzazione di mercato e l'indebitamento finanziario di una società. I provider dell'indice possono utilizzare diverse fonti di dati e la propria metodologia proprietaria che può dar luogo a valori di impronta carbonio differenti.

Copertura di portafoglio

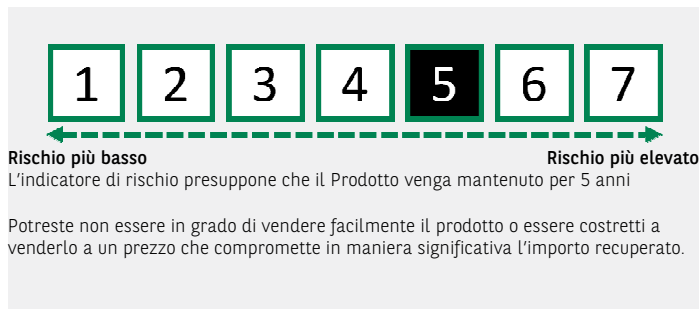
All'interno di un indice di riferimento replicato da un fondo, la copertura rappresenta la percentuale di titoli che beneficiano di un punteggio ESG o di un'impronta carbonio definita secondo la metodologia interna di BNPP AM, che può essere inferiore al tasso di copertura totale offerto dal fornitore dell'indice.

Per avere più informazioni sui criteri ESG, visita la pagina del sito BNPP AM: <https://www.bnpparibas-am.com/en/esg-scoring-framework/> & <https://www.bnpparibas-am.com/en/measuring-carbon-footprints/>
 Per informazioni più dettagliate sui nostri documenti di sostenibilità, si prega di fare riferimento alla pagina web di BNPP AM: <https://www.bnpparibas-am.com/en/sustainability-documents/>



RISCHIO

Profilo di Rischio e di Rendimento



L'indicatore sintetico di rischio è un'indicazione orientativa del livello di rischio di questo prodotto rispetto ad altri prodotti. Esprime la probabilità che il prodotto subisca perdite monetarie a causa di movimenti sul mercato o della nostra incapacità di pagare quanto dovuto.

Abbiamo classificato questo prodotto al livello 5 su 7, che corrisponde alla classe di rischio medio-alta.

Siate consapevoli del rischio valutario: se la valuta del vostro conto è diversa dalla valuta di questo Prodotto, i pagamenti che otterrete dipenderanno dal tasso di cambio tra le due valute. Questo rischio non è considerato nell'indicatore riportato sopra. Poiché la valuta del Prodotto è diversa dalla valuta di riferimento del Fondo, sarete esposti alle fluttuazioni tra tali valute.

Altri rischi rilevanti per il Prodotto non inclusi nell'indicatore sintetico di rischio:

- **Rischio operativo:** in caso di fallimento operativo della Società di gestione, di uno dei suoi rappresentanti o del depositario, gli investitori potrebbero subire diversi inconvenienti (ritardi nei pagamenti, nella consegna, ecc.).

Per ulteriori dettagli sui rischi, si rimanda al prospetto.

Questo prodotto non prevede alcuna protezione dall'andamento futuro del mercato e pertanto potreste perdere la totalità o parte dell'investimento.

Analisi del Rischio (3 anni, mensile)

Fondo

Volatilità	17,05
Tracking Error	0,03

DETTAGLI

Commissioni		Codici		
Comm. di Sottoscrizione Max.	3,00%	ISIN Code		LU1659681669
Comm. di Rimborso Max. (22.03.24)	3,00%	Quotazione	Bloomberg Code	Reuters Code
Commissione di Conversione max.	0,00%			
Spese Correnti (31.12.23)	0,26%			
Commissione di Gestione Max.	0,13%			
Dati dell'indice al 31.03.2024		Numeri Chiave		
Nome	MSCI USA SRI S-Series PAB 5% Capped (NTR) index (Bloomberg: M1CXUSC index)		NAV	20,28
Bloomberg Code	NKLD400U		Patrimonio del fondo (Dollaro USA mln)	2.221,68
Reuters Code	.MIUS000I3NUS		Dividendo (19.04.23)	0,28
Caratteristiche				
Forma Giuridica	Comparto di SICAV BNP PARIBAS EASY di diritto Luxembourg			
Orizzonte Temporale Raccomandato	5			
Indice di Riferimento	MSCI USA SRI S-Series PAB 5% Capped (NTR) index (Bloomberg: M1CXUSC index)			
Domicilio	Lussemburgo			
Data di Lancio	19.10.2017			
Gestore(s) del Fondo	Alexandre ZAMORA			
Società di Gestione	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg			
Società di Gestione Delegata	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe			
Banca Depositaria	BNP PARIBAS, Luxembourg Branch			
Valuta Base	USD			
Esecuzione degli ordini	NAV + 1			
SFDR article	Articolo 8 - Promozione delle caratteristiche ambientali o sociali			



GLOSSARIO

Tracking Error

Il tracking error misura la volatilità del rendimento relativo di un portafoglio rispetto al suo indice di riferimento.

Volatilità

La volatilità di un attivo è la deviazione standard del tasso di rendimento. In quanto misura della dispersione, valuta l'incertezza dei prezzi degli attivi, che è spesso assimilata al loro rischio. La volatilità può essere calcolata ex post (retrospettivamente) o stimata ex ante (in anticipo).

È possibile consultare un glossario dei termini finanziari riportati nel presente documento all'indirizzo <http://www.bnpparibas-am.com>

DISCLAIMER

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Italian branch succursale di Milano, è iscritta nell'elenco allegato all'Albo delle SGR di cui all'art. 35 del D.Lgs. 58/1998, alle sezioni società di gestione UE e gestori FIA UE del risparmio, autorizzata in Italia dalla Banca d'Italia, ha sede legale al n. 3 di P.zza Lina Bo Bardi a Milano. www.bnpparibas-am.it.

Il presente documento è redatto dalla suddetta società di gestioni di investimenti. Ha natura pubblicitaria e viene diffuso con finalità promozionali, è prodotto a mero titolo informativo e non costituisce:

1. un'offerta di acquisto o una sollecitazione di vendita; non costituirà la base di qualsivoglia contratto o impegno né ci si potrà fare affidamento in relazione a questi ultimi;
2. una consulenza finanziaria.

Il presente documento fa riferimento a uno o più strumenti finanziari autorizzati e regolamentati nella giurisdizione in cui hanno sede legale.

Non è stata avviata alcuna azione finalizzata a permettere l'offerta pubblica degli strumenti finanziari in altre giurisdizioni, salvo quanto indicato nella versione più recente del prospetto e nel documento contenente le informazioni chiave per l'investitore (KID) degli strumenti finanziari, in cui una tale azione sarebbe necessaria e, in particolare, negli Stati Uniti, a US persons (ai sensi del Regolamento S del United States Securities Act del 1933). Prima di effettuare una sottoscrizione in un Paese in cui gli strumenti finanziari sono autorizzati, gli investitori devono verificare gli eventuali vincoli o restrizioni legali potenziali relativi alla sottoscrizione, all'acquisto, al possesso o alla vendita degli strumenti finanziari in questione.

Gli investitori che intendano sottoscrivere degli strumenti finanziari devono, prima dell'adesione, leggere attentamente la versione più recente del prospetto e del documento contenente le informazioni chiave per l'investitore (KID) e consultare l'ultima relazione finanziaria pubblicata sugli strumenti finanziari in questione. Questa documentazione è disponibile nella lingua del collocatore o in inglese, gratuitamente presso le sedi dei collocatori e le filiali dei soggetti incaricati dei pagamenti, nonché sul sito web della società di gestione di investimenti www.bnpparibas-am.com, nella sezione "Panorama dei fondi".

Le opinioni espresse nel presente documento rappresentano il parere della società di gestione di investimenti alla data indicata e sono soggette a modifiche senza preavviso. La società di gestione di investimenti non è obbligata ad aggiornare o a modificare le informazioni e le opinioni contenute nel presente documento. Si raccomanda agli investitori di consultare i loro abituali consulenti finanziari, legali e fiscali per valutare l'adeguatezza e l'opportunità di investire negli strumenti finanziari. Si noti che i diversi tipi di investimento, se contenuti in questo documento, comportano gradi di rischio differenti e nessuna garanzia può essere fornita circa l'adeguatezza, l'idoneità o la redditività di un investimento specifico sul portafoglio di un cliente o potenziale cliente.

Tenuto conto dei rischi di natura economica, finanziaria e di sostenibilità e integrazione ESG, non può essere offerta alcuna garanzia che gli strumenti finanziari raggiungano i propri obiettivi d'investimento. Le performance possono variare in particolare in funzione degli obiettivi o delle strategie di investimento degli strumenti finanziari e di condizioni economiche e di mercato rilevanti, come i tassi di interesse. Le diverse strategie applicate agli strumenti finanziari possono avere un impatto significativo sui risultati presentati in questo documento. Le performance passate, ove illustrate, non sono garanzia di risultati futuri e il valore degli investimenti negli strumenti finanziari può, per sua natura, diminuire oltre che aumentare. È possibile che gli investitori non recuperino l'importo inizialmente investito.

I dati di performance, se presenti nel documento, non tengono conto dei costi, delle commissioni e degli oneri fiscali.

È possibile consultare la sintesi dei diritti degli investitori visitando il sito <https://www.bnpparibas-am.it/>. BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Italian branch si riserva la facoltà di cessare la commercializzazione degli organismi d'investimento collettivo del risparmio (OICR) nelle ipotesi previste dalla regolamentazione applicabile.

"The sustainable investor for a changing world" riflette l'obiettivo di BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Italian branch di includere lo sviluppo sostenibile nel quadro delle sue attività, anche se non tutti gli OICR soddisfano le previsioni indicate all'articolo 8, con una quota minima di investimenti sostenibili, o art. 9 del Regolamento Europeo 2019/2088 in merito all'informativa sulla sostenibilità nel settore dei servizi finanziari (Sustainable Finance Disclosure Regulation SFDR). Puoi trovare maggiori informazioni visitando il sito www.bnpparibas-am.com/en/sustainability.

Index disclaimer

Il fondo non è sponsorizzato, avallato, venduto o promosso da msci inc. ("msci"), dalle sue affiliate, dai suoi fornitori di informazioni o da terze parti coinvolte nella - o in qualche modo legate alla- compilazione, calcolo o creazione di un indice msci (collettivamente le "parti msci"). Gli indici msci sono di proprietà esclusiva di msci. I nomi msci e indice msci sono marchi di servizio di msci o delle sue affiliate e sono stati concessi in uso per alcune finalità al BNP Paribas Asset Management. Le parti msci non rilasciano alcuna dichiarazione o garanzia, esplicita o implicita agli emittenti, ai possessori di questo fondo o ad altre persone o soggetti in relazione all'idoneità di un investimento in fondi in generale o in questo fondo in particolare, né sulla capacità di un indice msci di replicare la performance del mercato azionario corrispondente. msci o le sue affiliate sono i concessionari di licenza di alcuni marchi, marchi di servizio e nomi commerciali degli indici msci che sono determinati, composti e calcolati da msci senza alcun riguardo per questo fondo, per l'emittente o per i possessori del fondo, né per altre persone o soggetti. nessuna delle parti msci ha alcun obbligo di tenere in considerazione le esigenze dell'emittente o dei possessori di questo fondo nel determinare, comporre o calcolare gli indici msci. Le parti msci non sono responsabili dei tempi, dei prezzi o della quantità delle emissioni del fondo, non hanno partecipato alle relative decisioni, né al calcolo dell'equazione con cui, o del corrispettivo verso il quale questo fondo può essere riscattato

