

TABLA RESUMEN A 30.09.2026

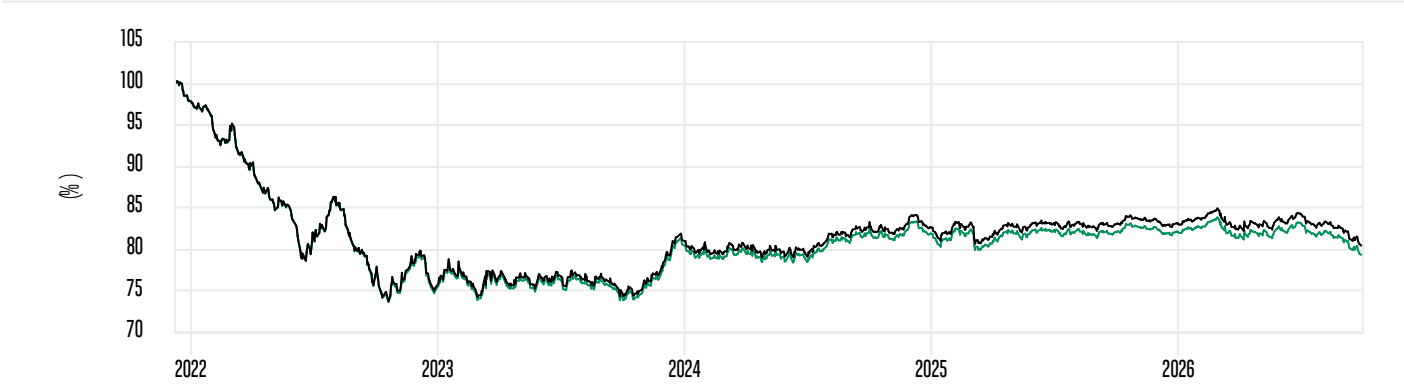
| Clase de Activo      | Indicador de referencia oficial   | No. de Posiciones del benchmark | Tamaño del Fondo (EUR millones) |
|----------------------|-----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| Renta fija           | Índice de Referencia Compuesto*   | 763                             | 207                             |
| Divisa de referencia | Índice de comparación             | SFDR article                    | MSCI ESG Fund Rating            |
| EUR                  | Bloomberg Euro Aggregate (EUR) RI | 9                               | AA                              |

\* J.P. Morgan Screened Green, Social and Sustainability (EUR) RI

INDEX DESCRIPTION:

El índice está compuesto por bonos verdes, sociales y de sostenibilidad emitidos en euros en los mercados desarrollados y emergentes, con énfasis en los bonos verdes que están alineados con los objetivos del Acuerdo de París. La metodología de evaluación y calificación de la gobernanza ambiental, social y corporativa (ESG) (como las convenciones medioambientales, las convenciones sobre derechos laborales, los derechos humanos, etc.) se aplica para inclinarse hacia los emisores que se encuentran en una posición más alta según los criterios de ESG y las cuestiones de «bonos climáticos certificados», y para infraponderar o eliminar a los emisores que se encuentran en una posición más baja. La fuente de etiquetado y certificación de bonos verdes, sociales y de sostenibilidad es Climate Bonds Initiative, un esquema de etiquetado para bonos, préstamos y otros instrumentos de deuda, basado en rigurosos criterios de científ y consistente con los objetivos del Acuerdo Climático de París de limitar el calentamiento a menos de 2 grados (www.climatebonds.net). Como resultado, los emisores sujetos a violaciones significativas de los principios del Pacto Mundial de las Naciones Unidas y los implicados en controversias graves relacionadas con el GES quedan excluidos del Índice. El tipo de enfoque implementado aquí es temático (el índice está compuesto por empresas que proporcionan productos y servicios que prueban soluciones concretas a desafíos ambientales y/o sociales específicos, buscando beneficiarse del crecimiento futuro previsto en estas áreas, contribuyendo al mismo tiempo al capital en la transición hacia un bajo nivel de carbono, Economía inclusiva). La estrategia extrafinanciera del Índice puede incluir limitaciones metodológicas como el riesgo relacionado con la inversión en ESG o el reequilibrio del Índice. Puede encontrar más información sobre el Índice, su composición, cálculo y normas para la revisión periódica y el reequilibrio, así como sobre la metodología general de los índices ESG de J.P Morgan en www.jpmmorgan.com. El Índice de Comparación es el Bloomberg Euro Aggregate (EUR) RI

RENDIMIENTO (ACUMULADO A 5 AÑOS) (EUR)



Rendimiento Acumulado a 30.09.2026 (en %)

|                         | Año en curso | 1 Mes | 3 Meses | 6 Meses | 1 Año | 2 Años | 3 Años | 4 Años | 5 Años |
|-------------------------|--------------|-------|---------|---------|-------|--------|--------|--------|--------|
| ● FONDO                 | -3,31        | -2,40 | -4,54   | -2,62   | -3,29 | -3,18  | 6,38   | 4,45   | -      |
| ● INDICE DE REFERENCIA  | -3,13        | -2,38 | -4,49   | -2,48   | -3,02 | -2,65  | 7,20   | 5,74   | -      |
| ● ÍNDICE DE COMPARACION | -2,52        | -1,87 | -3,77   | -1,89   | -2,29 | -1,16  | 7,95   | 7,28   | -      |



Rendimiento Anual a 30.09.2026 (en %)

|                         | 2025 | 2024 | 2023 | 2022   | 2021 | 2020 | 2019 | 2018 | 2017 | 2016 |
|-------------------------|------|------|------|--------|------|------|------|------|------|------|
| ● FONDO                 | 0,29 | 1,58 | 7,50 | -23,40 | -    | -    | -    | -    | -    | -    |
| ● INDICE DE REFERENCIA  | 0,57 | 1,82 | 7,83 | -23,14 | -    | -    | -    | -    | -    | -    |
| ● ÍNDICE DE COMPARACION | 1,25 | 2,63 | 6,57 | -16,69 | -    | -    | -    | -    | -    | -    |

(1) Todos los datos son netos de comisiones (en EUR en UCITS ETF, Capitalización).La rentabilidad histórica o el logro no es indicativo de los resultados actuales o futuros.  
Fuente: BNP Paribas Asset Management  
All data and performance are as of that date, unless otherwise stated.  
For further information, and in particular the risks of the product, please refer to the Prospectus and KIIDs of fund.



NÚMERO DE POSICIONES (BENCHMARK): (en %)

| Desglose por Divisa (%) |        | Frente al índice de comparación | Desglose por País (%) |        | Frente al índice de comparación |
|-------------------------|--------|---------------------------------|-----------------------|--------|---------------------------------|
| EUR                     | 100,00 | - 0,00                          | Francia               | 25,36  | + 4,98                          |
| Otros                   | -      | - 0,00                          | Alemania              | 16,89  | - 1,83                          |
| Total                   | 100,00 |                                 | Italia                | 7,61   | - 5,49                          |
|                         |        |                                 | España                | 3,59   | - 5,72                          |
|                         |        |                                 | Supranacional         | 20,38  | + 12,46                         |
|                         |        |                                 | Países Bajos          | 7,77   | + 3,24                          |
|                         |        |                                 | Estados Unidos        | 1,44   | - 3,03                          |
|                         |        |                                 | Bélgica               | 2,89   | - 0,84                          |
|                         |        |                                 | República de Irlanda  | 1,57   | + 0,64                          |
|                         |        |                                 | Suecia                | 1,57   | + 0,80                          |
|                         |        |                                 | Liquidez              | -      | - 0,00                          |
|                         |        |                                 | Otros                 | 10,92  | - 5,22                          |
|                         |        |                                 | Total                 | 100,00 |                                 |

| Desglose por Rating (%) |        | Frente al índice de comparación | Desglose por Vencimiento (%) |        | Frente al índice de comparación |
|-------------------------|--------|---------------------------------|------------------------------|--------|---------------------------------|
| AAA                     | 37,75  | + 8,44                          | < 1 año                      | 2,94   | + 2,63                          |
| AA                      | 2,20   | + 0,55                          | 1 - 3 años                   | 17,90  | - 7,48                          |
| AA-                     | 5,36   | + 3,27                          | 3 - 5 años                   | 18,93  | - 3,59                          |
| A+                      | 23,46  | + 1,59                          | 5 - 7 años                   | 19,51  | + 3,19                          |
| A                       | 4,89   | - 5,47                          | 7 - 10 años                  | 12,47  | - 3,71                          |
| A-                      | 4,78   | - 0,92                          | 10 - 15 años                 | 12,72  | + 3,95                          |
| BBB+                    | 12,83  | - 3,89                          | > 15 años                    | 15,52  | + 5,00                          |
| BBB                     | 4,84   | + 0,43                          | Otros                        | -      | - 0,00                          |
| BBB-                    | 1,95   | - 0,65                          | Liquidez                     | -      | - 0,00                          |
| Otros                   | 1,89   | - 3,15                          | Total                        | 100,00 |                                 |
| Sin calificación        | 0,05   | - 0,20                          |                              |        |                                 |
| Liquidez                | -      | - 0,00                          |                              |        |                                 |
| Total                   | 100,00 |                                 |                              |        |                                 |

Datos: BNP Paribas Asset Management, a 30.09.2026.  
Las compañías mencionadas se citan con fines puramente ilustrativos, no deben interpretarse como una solicitud de compra y su mención tampoco constituye una recomendación o consejo de inversión.  
Los datos de las fichas mensuales se calculan empleando datos contables oficiales calculados en base a la fecha de negociación.

Puntuación global ESG

83,15

BNPPAM INDICADORES DE SOSTENIBILIDAD

CONTRIBUCIONES ESG

|            | Contribución medioambiental | Contribución social | Contribución de buen gobierno |
|------------|-----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| Portafolio | 21,78                       | 9,98                | 1,39                          |

COBERTURA DE CARTERA

|               | Cobertura |
|---------------|-----------|
| Cobertura ESG | 100,00 %  |

CARACTERÍSTICAS DE SOSTENIBILIDAD DEL MSCI

(DISPONIBLE EN EL SITIO WEB DEL MSCI A FINALES DE MES)

|                                                                |       |                                                 |        |
|----------------------------------------------------------------|-------|-------------------------------------------------|--------|
| MSCI ESG Fund Rating                                           | AA    |                                                 |        |
| MSCI Weighted Average Carbon Intensity (toneladas de CO2e/\$ M | 44.03 | MSCI Weighted Average Carbon Intensity Coverage | 48.88% |
| Puntuación de calidad de ESG (0-10)                            | 7.28  |                                                 |        |

Puntuación total de cobertura ESG

La metodología interna de BNP Paribas Asset Management determina la puntuación ESG de un emisor evaluando su desempeño frente a sus homólogos en un conjunto limitado de cuestiones ESG de ámbito medioambiental (por ejemplo el cambio climático), social (gestión de recursos humanos, entre otros temas) y de buen gobierno (por ejemplo independencia y competencia de los directores). Para determinar la puntuación ESG de cada empresa se emplean múltiples datos y fuentes de información (por ejemplo Sustainalytic, IIS y Trucost). Si los compromisos y prácticas del emisor en un pilar de evaluación (E, S o G) son mejores que los de sus homólogos, recibirá una "contribución" positiva para dicho pilar. Cada emisor recibe una puntuación final de 1 a 99, que corresponde a una referencia de 50 más la suma de las contribuciones de cada uno de los tres pilares.

Contribuciones ESG

Las contribuciones ESG son determinadas por los analistas de BNP Paribas Asset Management en base a criterios detallados para evaluar de forma sistemática los compromisos, rentabilidad y prácticas de las empresas en los ámbitos medioambiental, social y de gobierno corporativo. Cada una de estas contribuciones a nivel de cartera es la media ponderada de las contribuciones de las posiciones individuales en la cartera.La contribución medioambiental (E) tiene en cuenta el cambio climático, la gestión del riesgo medioambiental y el uso de recursos naturales entre otros temas. La contribución social (S) tiene en cuenta la gestión de recursos humanos, la calidad del diálogo social y el respecto por la diversidad entre otros temas. La contribución de buen gobierno (G) tiene en cuenta la transparencia en la compensación de los equipos directivos, la lucha contra la corrupción y la igualdad de género entre otros temas.

Cobertura de cartera

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

MSCI ESG Fund Rating

La calificación ESG (MSCI ESG, por sus siglas en inglés) se calcula como un mapeo directo de las puntuaciones de calidad de ESG (ej. AAA = 8.6-10). Las calificaciones ESG varían entre Leader (AAA: AA), average (A, BBB, BB) y laggard (B, CCC).

MSCI Weighted Average Carbon Intensity

Mide la exposición de un fondo a empresas con alto consumo de carbono. Esta cifra representa las emisiones estimadas de gases de efecto invernadero por 1 millones \$ en ventas en todas las participaciones del fondo. Esto permite comparar fondos de diferentes tamaños.

MSCI Weighted Average Carbon Intensity Coverage

Es el porcentaje de participaciones del fondo para el que se dispone de datos sobre la intensidad de carbono del MSCI. La métrica MSCI Weighted Average Carbon Intensity se muestra para fondos con cualquier cobertura. Los fondos con baja cobertura pueden no representar totalmente las características de carbono del fondo dada la falta de cobertura.

Puntuación de calidad de ESG (0-10)

La puntuación de calidad MSCI ESG (0-10) para los fondos se calcula utilizando la media ponderada de las puntuaciones ASG de las posiciones del fondo. La puntuación también tiene en cuenta la tendencia de las posiciones en la calificación ESG y la exposición del fondo a posiciones de la categoría rezagada. El índice MSCI califica las posiciones subyacentes en función de su exposición a los riesgos ASG específicos de su sector y de su capacidad para gestionarlos en comparación con sus homólogos.

Para obtener más información sobre indicadores ESG, consulta la página web de BNP Paribas Asset Management: <https://www.bnpparibas-am.com/en/esg-scoring-framework/> & <https://www.bnpparibas-am.com/en/measuring-carbon-footprints/>

Para obtener información más detallada sobre nuestros documentos de sostenibilidad, consulte la página web de BNPP AM: <https://www.bnpparibas-am.com/en/sustainability-documents/>



## Label(s)



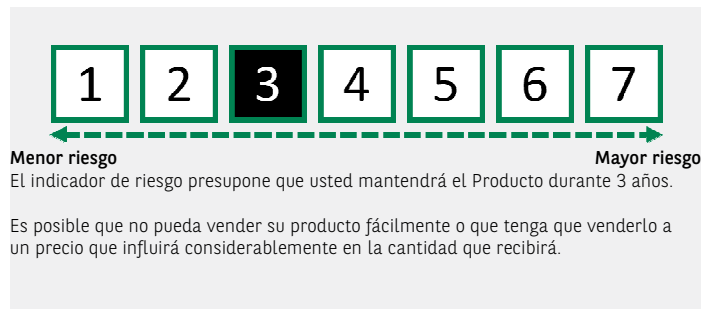
El fondo ha recibido el reconocimiento de la Belgian Central Labeling Agency con la etiqueta Towards Sustainability.

La etiqueta Towards Sustainability sirve de ayuda a todo tipo de inversores minoristas e institucionales que busquen soluciones de ahorro y de inversión más sostenibles. A su vez, anima a las instituciones financieras a ofrecer una gama diversa y de alta calidad de productos sostenibles.

Para obtener más información sobre la etiqueta, consulte el sitio web:  
[www.towardssustainability.be](http://www.towardssustainability.be)

## RIESGO

## Perfil de Riesgo y Remuneración



## Análisis de Riesgo (1 año, semanal)

## Fondo

|                                                                   |      |
|-------------------------------------------------------------------|------|
| Volatilidad                                                       | 3,65 |
| Error de Seguimiento                                              | 0,04 |
| Tracking Error Oficial Índice de referencia/Índice de comparación | 0,79 |
| Duración Modificada (30.09.2026)                                  | 6,65 |
| Rent. Hasta Vencimiento (30.09.2026)                              | 4,07 |
| Cupón medio                                                       | 2,04 |
| Duration                                                          | 6,78 |

El indicador resumido de riesgo es una guía del nivel de riesgo de este producto en comparación con otros productos. Muestra las probabilidades de que el producto pierda dinero debido a la evolución de los mercados o porque no podamos pagarle.

Hemos clasificado este producto en la clase de riesgo- en una escala que se traduce en un riesgo medio-bajo.

La categoría de riesgo se debe a que se invierte principalmente en instrumentos de tipos de interés. Se recuerda al inversor que una subida de los tipos de interés conlleva una caída del valor de las inversiones en bonos e instrumentos de deuda y, de forma más general, instrumentos de renta fija.

**Tenga en cuenta el riesgo cambiario. Si la moneda de su cuenta es diferente de la moneda de este Producto, los pagos que reciba dependerán del tipo de cambio entre las dos monedas. Este riesgo no se tiene en cuenta en el indicador anterior.**

Otros riesgos de importancia significativa para el Producto no incluidos en el indicador resumido de riesgo:

- **Riesgo de crédito:** Riesgo de que se degrade la calificación crediticia de un emisor o de que este incurra en impago, lo que puede comportar una reducción del valor de los instrumentos financieros asociados.
- **Riesgo de liquidez:** Este riesgo se debe a la dificultad de vender un título a su valor razonable y dentro de un tiempo razonable debido a la falta de compradores.
- **Riesgo operativo:** En caso de incumplimiento operativo por parte de la Sociedad Gestora, de uno de sus representantes o del depositario, los inversores podrían sufrir diversas alteraciones (retraso en los pagos, en las entregas, etc.).

Para obtener más información sobre los riesgos, consulte el folleto.

Este Producto no incluye ninguna protección frente a la evolución futura del mercado, por lo que podría perder parte o la totalidad de su inversión.

## INFORMACIÓN

## Comisiones

|                                        |       |
|----------------------------------------|-------|
| Comisiones Máx. por Suscripción        | 3,00% |
| Comisiones Máx. por Rescate (05.10.26) | 3,00% |
| Comisiones de Conversión máx.          | 0,00% |
| Gastos Corrientes (31.12.25)           | 0,25% |
| Comisiones Máx. de Admin.              | 0,13% |

## Index data as of 30.09.2026

|      |                                                                |
|------|----------------------------------------------------------------|
| Name | J.P. Morgan Screened Green, Social and Sustainability (EUR) RI |
|------|----------------------------------------------------------------|

## Códigos

|                  |              |
|------------------|--------------|
| Código ISIN      | LU2365458814 |
| Código Bloomberg | GSSBD FP     |

## Quotation

## Código

## Código Reuters

|                |           |                |
|----------------|-----------|----------------|
| iNAV           | IGGSD     | GSSBDINAV=IHSM |
| Euronext Paris | GSSBD FP  | ASRQ.PA        |
| Swiss Exchange | GSSBD SE  | N/A            |
| Borsa Italiana | EJEGSS IM | N/A            |

## Datos Clave

|                                  |        |
|----------------------------------|--------|
| Valor Liquidativo (VL)           | 7,94   |
| Tamaño del Fondo (Euro millones) | 207,45 |

## Características

|                                    |                                                                |
|------------------------------------|----------------------------------------------------------------|
| Forma Legal                        | Domicilio SICAV BNP PARIBAS EASY de derecho Luxemburgués       |
| Horizonte de Inversión Recomendado | 3 años                                                         |
| Índice de Referencia               | J.P. Morgan Screened Green, Social and Sustainability (EUR) RI |
| Domicilio                          | Luxemburgo                                                     |
| Fecha de Apertura                  | 10.12.2021                                                     |
| Gestor                             | Emilija POPOVIC                                                |



Características

|                             |                                               |
|-----------------------------|-----------------------------------------------|
| Compañía Operadora          | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg       |
| Gestora Delegada            | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe           |
| Depositario                 | BNP PARIBAS, Luxembourg Branch                |
| Divisa Base                 | EUR                                           |
| Subscription/execution type | VL + 1                                        |
| Artículo SFDR               | Artículo 9 - Objetivo de inversión sostenible |



## GLOSARIO

### Error de Seguimiento

El error de seguimiento o tracking error mide la volatilidad del rendimiento relativo de una cartera en relación su indicador de referencia.

### Volatilidad

La volatilidad de un activo es la desviación estándar de su rendimiento. Como medida de dispersión, valora la incertidumbre de los precios de los activos, lo que a menudo se equipara a su riesgo. La volatilidad puede calcularse ex post (retrospectivamente) o estimarse ex ante (anticipadamente).

Consulta el glosario de los términos financieros que aparecen en este documento en <http://www.bnpparibas-am.com>.

## INFORMACIÓN IMPORTANTE

BNP Paribas Asset Management Europe, «la sociedad gestora de inversiones» es una «sociedad por acciones simplificada» con domicilio social sito en 1 boulevard Haussmann 75009 París, France, inscrita en el Registro Mercantil (RCS) de París con el número 319 378 832 e inscrita ante la Autoridad de los Mercados Financieros (AMF) con el número GP 96002.

El presente material ha sido emitido y elaborado por la sociedad gestora de inversiones. Contiene opiniones y datos estadísticos que se consideran legítimos y correctos en el día de su publicación de acuerdo con el contexto económico y financiero de ese momento. El presente documento no constituye asesoramiento de inversión ni forma parte de ninguna oferta o invitación para suscribir o comprar instrumentos financieros, ni servirá de base, en todo o en parte, de ningún contrato o compromiso de ningún tipo.

El presente documento se proporciona sin conocer la situación de los inversores. Antes de proceder a una suscripción, los inversores deberán comprobar en qué países están registrados y autorizados para la venta al público los instrumentos financieros a los que se refiere el presente documento. En particular, los instrumentos financieros no pueden ofrecerse o venderse al público en Estados Unidos. Los inversores que sopesen realizar una suscripción deben leer detenidamente el folleto y el documento de datos fundamentales para el inversor más recientes autorizados por la autoridad reguladora, que se encuentran disponibles en el sitio web. Se recomienda a los inversores que consulten los informes financieros más recientes, también disponibles en el sitio web. Los inversores deben consultar a sus propios asesores jurídicos o fiscales antes de invertir. Debido a los riesgos económicos y de mercado, no puede garantizarse que los instrumentos financieros vayan a conseguir sus objetivos de inversión. Su valor puede incrementarse o disminuir. En particular, las variaciones de los tipos de cambio de las divisas pueden afectar al valor de una inversión. La rentabilidad se indica una vez descontadas las comisiones de gestión y se calcula empleando rentabilidades globales que tienen en cuenta el tiempo, con dividendos netos y reinversión de intereses, y no incluye comisiones de suscripción y/o reembolso, comisiones de tipos de cambio ni impuestos. La rentabilidad histórica no constituye una garantía de los resultados futuros.

Toda la información mencionada en el presente documento se encuentra disponible en [www.bnpparibas-am.com](http://www.bnpparibas-am.com)

