

DASHBOARD AL 30.09.2026

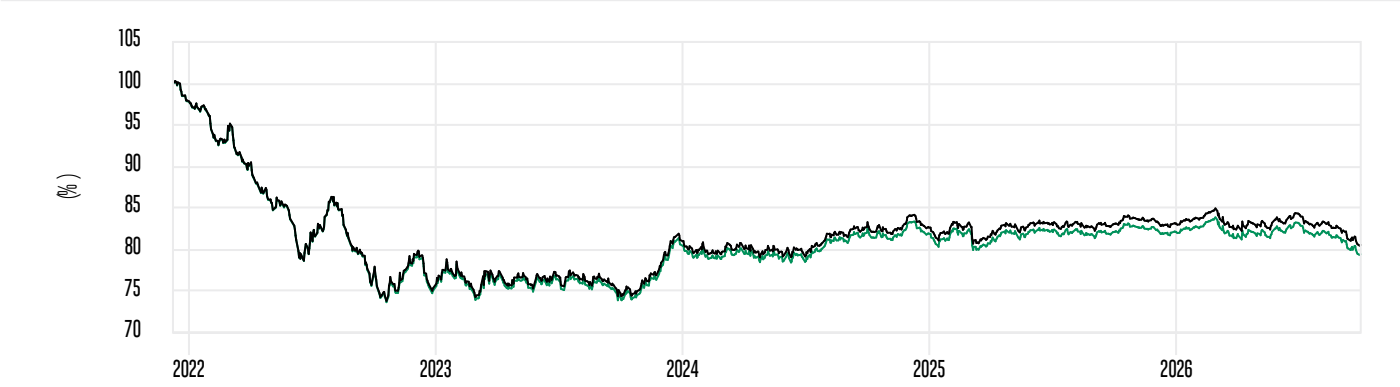
Asset class	Benchmark ufficiale	Posizioni del benchmark	Patrimonio del fondo (EUR mln)
Reddito fisso	Benchmark Composito*	763	207
Valuta di negoziazione	Indice di comparazione	Articolo SFDR	MSCI ESG Fund Rating
EUR	Bloomberg Euro Aggregate (EUR) RI	9	AA

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

DESCRIZIONE DELL'INDICE:

L'Indice è composto da obbligazioni verdi, sociali e di sostenibilità emesse in euro su mercati sviluppati ed emergenti con un'enfasi sui green bond che sono in linea con gli obiettivi dell'accordo di Parigi. La metodologia di valutazione e di screening per la governance ambientale, sociale e aziendale (ESG) (come le convenzioni ambientali, le convenzioni sui diritti del lavoro, i diritti umani, ecc.) viene applicata per orientare gli emittenti classificati più in alto in base ai criteri ESG e alle emissioni di obbligazioni climatiche certificate, e per sottoporli o rimuovere gli emittenti che si classificano più in basso. La fonte per l'etichettatura e la certificazione dei bond verdi, sociali e di sostenibilità è Climate Bonds Initiative, uno schema di etichettatura per obbligazioni, prestiti e altri strumenti di debito, basato su rigorosi criteri scientifici e in linea con gli obiettivi dell'accordo sul clima di Parigi di limitare il riscaldamento a meno di 2 gradi (www.climatebonds.net). Di conseguenza, gli emittenti soggetti a violazioni significative dei principi del Global Compact delle Nazioni Unite e di coloro che sono coinvolti in gravi controversie correlate al GES sono esclusi dall'Indice. Il tipo di approccio qui attuato è tematico (l'indice è composto da imprese che forniscono prodotti e servizi che dimostrano soluzioni concrete a specifiche sfide ambientali e/o sociali, cercando di trarre vantaggio dalla crescita futura prevista in queste aree, contribuendo al contempo al capitale per la transizione verso un basso tenore di carbonio, Economia inclusiva). La strategia extra-finanziaria dell'Indice può comprendere limitazioni metodologiche quali il rischio connesso agli investimenti ESG o il ribilanciamento dell'Indice. Ulteriori informazioni sull'Indice, la sua composizione, il calcolo e le regole per la revisione periodica e il ribilanciamento, nonché sulla metodologia generale che sta alla base degli indici J.P Morgan ESG, sono disponibili sul www.jpmmorgan.com. L'indice di confronto è il Bloomberg Euro Aggregate (EUR) RI

PERFORMANCE (CUMULATE SU 5 ANNI) (EUR)



Performance Cumulata al 30.09.2026 (in %)

	YTD	1 Mese	3 Mesi	6 Mesi	1 Anni	2 Anni	3 Anni	4 Anni	5 Anni
● FONDO	-3,31	-2,40	-4,54	-2,62	-3,29	-3,18	6,38	4,45	-
● INDICE DI RIFERIMENTO	-3,13	-2,38	-4,49	-2,48	-3,02	-2,65	7,20	5,74	-
● INDICE DI COMPARAZIONE	-2,52	-1,87	-3,77	-1,89	-2,29	-1,16	7,95	7,28	-

Performance dell’Anno Solare al 30.09.2026 (in %)

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

(1) Performance al netto delle commissioni (in EUR in UCITS ETF, Capitalizzazione). 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.
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 %)

per Valuta (%)			Against Comparison Index	Allocazione geografica (%)			Against Comparison Index
EUR	100,00	- 0,00		Francia	25,36	+ 4,98	
Altro	-	- 0,00		Germania	16,89	- 1,83	
Totale	100,00			Italia	7,61	- 5,49	
				Spagna	3,59	- 5,72	
				Sovranazionali	20,38	+ 12,46	
				Paesi Bassi	7,77	+ 3,24	
				Stati Uniti	1,44	- 3,03	
				Belgio	2,89	- 0,84	
				Irlanda	1,57	+ 0,64	
				Svezia	1,57	+ 0,80	
				Liquidità	-	- 0,00	
				Altro	10,92	- 5,22	
				Totale	100,00		

per Rating (%)			Against Comparison Index	per Scadenza (%)			Against Comparison Index
AAA	37,75	+ 8,44		< 1 anno	2,94	+ 2,63	
AA	2,20	+ 0,55		1 - 3 anni	17,90	- 7,48	
AA-	5,36	+ 3,27		3 - 5 anni	18,93	- 3,59	
A+	23,46	+ 1,59		5 - 7 anni	19,51	+ 3,19	
A	4,89	- 5,47		7 - 10 anni	12,47	- 3,71	
A-	4,78	- 0,92		10 - 15 anni	12,72	+ 3,95	
BBB+	12,83	- 3,89		> 15 anni	15,52	+ 5,00	
BBB	4,84	+ 0,43		Altro	-	- 0,00	
BBB-	1,95	- 0,65		Liquidità	-	- 0,00	
Altro	1,89	- 3,15		Totale	100,00		
Privo di rating	0,05	- 0,20					
Liquidità	-	- 0,00					
Totale	100,00						

Fonte: BNP Paribas Asset Management, al 30.09.2026.

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.



BNPPAM INDICATORI EXTRA FINANZIARI

Punteggio totale ESG
83,15

CONTRIBUTI ESG

	Contributo 'Ambientale'	Contributo 'Sociale'	Contributo 'Governance'
Portafoglio	21,78	9,98	1,39

COPERTURA DI PORTAFOGLIO

	Copertura
Copertura ESG	100,00%

CARATTERISTICHE DI SOSTENIBILITÀ MSCI (COME DISPONIBILE SUL SITO WEB DEL MSCI ALLA FINE DEL MESE PRECEDENTE)

MSCI ESG Fund Rating	AA		
MSCI Weighted Average Carbon Intensity (ton of CO2e/\$ M Sales)	44.03	MSCI Weighted Average Carbon Intensity Coverage	48.88%
MSCI ESG Quality Score (0-10)	7.28		

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, performance 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.

Copertura di portafoglio

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

Il rating MSCI ESG è calcolato come mappatura diretta dei punteggi di qualità ESG alle categorie di rating delle lettere (ad es. AAA = 8.6-10). I rating ESG variano da leader (AAA: AA), media (A, BBB, BB) a laggard (B, CCC).

MSCI Weighted Average Carbon Intensity

Misura l'esposizione di un fondo alle società ad alta intensità di carbonio. Questo dato rappresenta le emissioni stimate di gas serra per 1 milioni \$ nelle vendite delle partecipazioni del fondo. Ciò consente confronti tra fondi di dimensioni diverse.

MSCI Weighted Average Carbon Intensity Coverage

È la percentuale delle partecipazioni del fondo per cui sono disponibili i dati MSCI Carbon Intensity. La metrica MSCI Weighted Average Carbon Intensity è visualizzata per i fondi con qualsiasi copertura. I fondi con una bassa copertura potrebbero non rappresentare appieno le caratteristiche del carbonio del fondo a causa della mancanza di copertura.

MSCI ESG Quality Score (0-10)

L'indice MSCI ESG Quality Score (0-10) per i fondi è calcolato utilizzando la media ponderata dei punteggi ESG delle posizioni dei fondi. Il Punteggio considera anche l'andamento dei rating ESG e l'esposizione del fondo alle posizioni nella categoria laggard. Tassi MSCI sottostanti le posizioni in base alla loro esposizione ai rischi ESG specifici del settore e alla loro capacità di gestire tali rischi rispetto ai concorrenti.

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/>



Label(s)



Il fondo ha ottenuto il riconoscimento dall'Agenzia centrale belga per l'etichettatura sotto forma di etichetta Toward Sustainability.

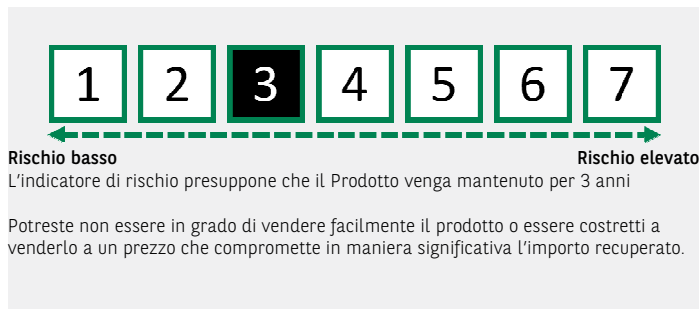
L'etichetta Towards Sustainability aiuta tutti i tipi di investitori al dettaglio e istituzionali alla ricerca di soluzioni di investimento e risparmio più sostenibili. Ciò, a sua volta, incoraggia gli istituti finanziari a offrire una gamma diversificata e di alta qualità di prodotti sostenibili.

Per ulteriori informazioni sull'etichetta, visitare il sito Web:

www.towardssustainability.be

RISCHIO

Profilo di Rischio e di Rendimento



Analisi del Rischio (1 anno, settimanale)

Fondo

Volatilità	3,65
Tracking Error	0,04
Tracking Error Official Benchmark/Comparison Index	0,79
Duration Modificata (30.09.2026)	6,65
Rendimento a Scadenza (30.09.2026)	4,07
Cedola Media	2,04
Duration	6,78

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 3 su 7, che è una classe di rischio compresa tra bassa e media.

La categoria di rischio è giustificata dall'investimento prevalentemente in Strumenti a tasso d'interesse. Si richiama l'attenzione degli investitori sul fatto che l'aumento dei tassi d'interesse comporta una diminuzione del valore degli investimenti in obbligazioni e strumenti di debito e, più in generale, degli investimenti in strumenti a reddito fisso.

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.

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

- **Rischio di credito:** rischio di declassamento del rating di un emittente o della relativa inadempienza, che possono comportare una riduzione del valore degli strumenti finanziari associati.
- **Rischio di liquidità:** questo rischio deriva dalla difficoltà di vendere un titolo al suo valore equo ed entro un periodo di tempo ragionevole a causa di una mancanza di acquirenti.
- **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.

DETTAGLI

Commissioni

Comm. di Sottoscrizione Max.	3,00%
Comm. di Rimborso Max. (05.10.26)	3,00%
Commissione di Conversione max.	0,00%
Spese Correnti (31.12.25)	0,25%
Commissione di Gestione Max.	0,13%

Dati dell'indice al 30.09.2026

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

Codici

ISIN Code	LU2365458814
Bloomberg Code	GSSBD FP

Quotazione

Bloomberg Code

Reuters Code

iNAV	IGGSD	GSSBDINAV=IHSM
Euronext Paris	GSSBD FP	ASRQ.PA
Swiss Exchange	GSSBD SE	NC
Borsa Italiana	EJEGSS IM	NC

Numeri Chiave

NAV	7,94
Patrimonio del fondo (Euro mln)	207,45

Caratteristiche

Forma Giuridica	Comparto di SICAV BNP PARIBAS EASY di diritto Luxembourg
Orizzonte Temporale Raccomandato	3 anni
Indice di Riferimento	J.P. Morgan Screened Green, Social and Sustainability (EUR) RI
Domicilio	Lussemburgo
Data di Lancio	10.12.2021



Caratteristiche

Gestore(i) del Fondo	Emilija POPOVIC
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	EUR
Esecuzione degli ordini	NAV + 1
Articolo SFDR	Articolo 9 - Obiettivo di investimento sostenibile



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, 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 si riserva la facoltà di cessare la commercializzazione degli organismi d'investimento collettivo del risparmio (OICR) nelle ipotesi previste dalla regolamentazione applicabile.

