

## DASHBOARD AU 29.12.2022

Catégorie ESMA	Indice de référence	Nb de positions dans le portefeuille	Actif du compartiment (EUR mn.)
Monétaire Standard VNAV	Cash Index Euro Short Term Rate (EUR) RI 360 Days	176	4721

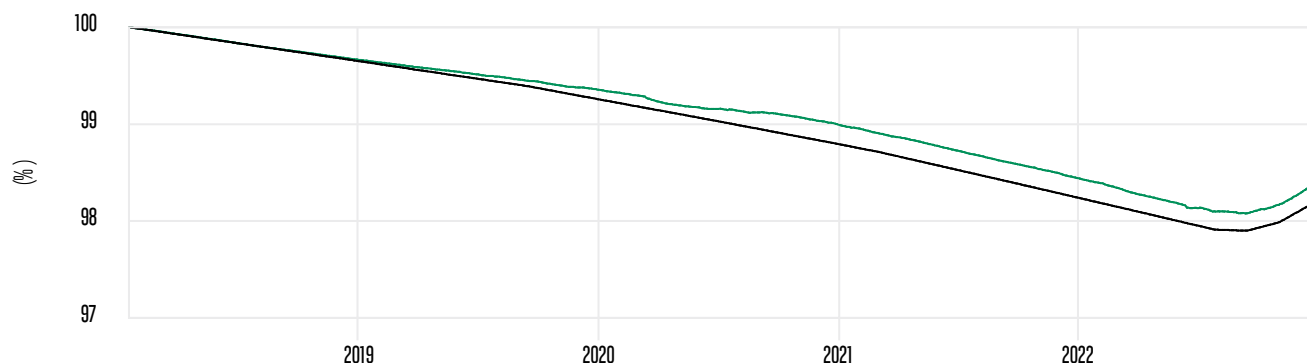
Niveau de risque et de rendement	Performance YTD (1)	Perf. annualisée sur 3 ans (2)	
1 2 3 4 5 6 7	-0,037 % Indice de référence -0,026 %	-0,32 % Indice de référence -0,35 %	

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

(2) Basée sur 360 jours

Le Fonds fait partie de la catégorie des fonds monétaires à valeur nette d'inventaire variable standard (« FM ») tel que définis par le Règlement (UE) 2017/1131 du Parlement européen et du Conseil du 14 juin 2017 sur les fonds monétaires (le « Règlement »).

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



## Performances calendaires au 29.12.2022 (en %)

	2022	2021	2020	2019	2018	2017	2016	2015	2014	2013
● FONDS	-0,04	-0,56	-0,36	-0,31	-0,35	-0,30	-0,10	0,10	0,30	0,10
● INDICE DE RÉFÉRENCE	-0,03	-0,56	-0,47	-0,40	-0,37	-0,40	-0,30	-0,10	0,10	0,10

## Performances mensuelles annualisées au 29.12.2022 (en %)

	12.2022	11.2022	10.2022	09.2022	08.2022	07.2022	06.2022	05.2022	04.2022	03.2022	02.2022	01.2022
● FONDS	1,70	1,29	0,68	0,29	-0,20	-0,38	-0,63	-0,59	-0,56	-0,77	-0,68	-0,53
● INDICE DE RÉFÉRENCE	1,54	1,33	0,66	0,30	-0,09	-0,52	-0,58	-0,59	-0,59	-0,58	-0,58	-0,58

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

Un Fonds Monétaire (ci-après un "FM") n'est pas un produit garanti. Un investissement dans un FM diffère d'un placement dans des dépôts en ce qu'il comporte le risque de fluctuation du principal investi dans un FM. Le FM n'a recours à aucun prestataire externe pour garantir la liquidité des FM ou la stabilisation de la VL par action. Toute perte du principal est assumée par les actionnaires.

A compter de sa création jusqu'au 9 avril 2013, le FCP était nourricier du FCP Klé Gestion 3 Mois.

Les performances ou réalisations du passé ne sont pas indicatives des performances futures.

Source : BNP Paribas Asset Management



## POSITIONS : % DU PORTEFEUILLE

## Principales positions

BNPP CASH INVEST I + C	3,18
NORDEA BANK ABP 04-OCT-2023	3,10
NATIXIS SA 13-MAR-2023	2,34
STANDARD CHARTERED PLC 25-OCT-2023	2,27
SOCIETE GENERALE SA 18-SEP-2023	2,12
KBC BANK NV 09-MAR-2023	2,11
LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC	1,97
COOPERATIEVE RABOBANK UA 30-OCT-2023	1,72
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 27-OCT-2023	1,63
SOCIETE GENERALE SA 15-SEP-2023	1,59

**Nb de positions dans le portefeuille** **176**

Nous attirons votre attention sur le fait que nous pouvons investir plus de 5 % des actifs du fonds dans des administrations, institutions ou organismes qui émettent ou garantissent séparément ou conjointement des instruments du marché monétaire

## par Maturité

2 - 7 jours	1,06
8 - 30 jours	11,56
31 - 90 jours	18,27
91 - 180 jours	11,39
181 - 397 jours	40,78
> 397 jours	0,70
Liquidités	16,25
<b>Total</b>	<b>100,00</b>

Prenant en compte la maturité réelle de l'instrument et non les exceptions potentielles décrites dans le règlement des fonds monétaires pour le calcul des actifs à échéance hebdomadaire.

## par Notation

## Cash, repos, IRS

Cash, repos, IRS 12,40

## Not rated

Non noté 0,15

## OPCVM

OPCVM 3,85

## Notation long terme + UCITS

A+ 2,63

A 0,17

A- 1,95

## Notation court terme

A-1+ 13,56

A-1 34,43

A-2 25,96

A-3 3,54

Non-investment grade 1,35

**Total** **99,98**

Notation la plus basse parmi celles de Fitch, Moody's et S&P.

Source : BNP Paribas Asset Management, en date du 29.12.2022

Sources : Fitch, Moody's, S&P. Les notations < BBB- correspondent à la catégorie de titres à haut rendement ou titres spéculatifs

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.

## par Type d'Instruments

European commercial paper (ecp)	37,28
Negotiable european commercial paper (neucp)	30,24
Liquidités	12,40
European (ex. uk) certificate of deposit	10,81
Obligations	4,75
Fonds monétaires	3,85
other certificates of deposit (cd)	0,52
swaps	0,15
<b>Total</b>	<b>100,00</b>



## INFORMATIONS EXTRA-FINANCIÈRES

Score ESG global

62,22

Indice de référence : 53,85

## CONTRIBUTION ESG

	Contrib. environnementale (E)	Contrib. sociale (S)	Contrib. gouvernance (G)
Portefeuille	8,60	1,89	1,73
Indice de référence	1,59	1,90	0,37

## COUVERTURE DU PORTEFEUILLE

	Couverture
Couverture ESG	100,00 %

## Indice de référence ESG

Pour plus d'information sur la définition du benchmark ESG, veuillez-vous référer à la rubrique « stratégie d'investissement » du prospectus disponible à cette adresse : [www.bnpparibasam.com](http://www.bnpparibasam.com)

## 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 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

Au sein d'un portefeuille ou d'un indice de référence, BNPP AM statue tout d'abord sur l'éligibilité des instruments à obtenir des indicateurs ESG en fonction de leur nature. Au sein de ces instruments éligibles d'après la méthodologie interne de BNPP AM, la couverture représente le pourcentage de titres bénéficiant d'un score ESG ou d'une empreinte carbone. Les titres non éligibles à une évaluation comprennent, de manière non exhaustive, les liquidités, les fonds externes.

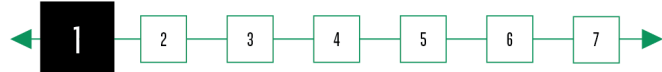
Pour plus d'info sur les indicateurs ESG ou sur les méthodologies de calcul des taux de couvertures veuillez-vous référer à notre page web dédiée: <https://www.bnpparibas-am.com/fr/dispositif-de-notation-esg/> & <https://www.bnpparibas-am.com/fr/mesure-de-lempreinte-carbone/>



## RISQUE

## Niveau de risque et de rendement

La note de risque et de rendement pour ce fonds est:



Risque faible=Rendement potentiellement plus faible

1 : risque le moins élevé; 7 : risque le plus élevé. SRRI : indicateur synthétique de risque et de rendement. Plus le risque est élevé, plus l'horizon d'investissement recommandé est long.

Risque élevé=Rendement potentiellement plus élevé

## Analyse de risque

	Fonds
Volatilité (sur 3 ans, mensuelle)	0,15
WAM (jours) (29.12.2022)	3
WAL (jours) (29.12.2022)	150

Les investissements réalisés dans des compartiments sont soumis aux fluctuations du marché et aux risques inhérents aux investissements en valeurs mobilières. La valeur des investissements et les revenus qu'ils génèrent peuvent enregistrer des hausses comme des baisses et il se peut que les investisseurs ne récupèrent pas leur investissement initial. Le fonds décrit ci-dessus comprend un risque de perte en capital.

Pourquoi le fonds relève-t-il de cette catégorie précise ?

Cette catégorie de risque se justifie par l'investissement dans des instruments du marché monétaire et des obligations à court terme à faible volatilité.

D'autres risques importants pour le fonds, mais qui ne sont pas adéquatement pris en considération par l'indicateur, sont exposés ci-dessous :

- **Risque de crédit:** risque de dégradation de la signature d'un émetteur ou sa défaillance pouvant entraîner une baisse de la valeur des instruments financiers qui lui sont associés.

## DÉTAILS

## Commissions

Frais d'entrée max.	0,50%
Frais de sortie max.	0,00%
Frais courants estimés (01.01.23)	0,20%
Commission de gestion max.	0,60%

## Chiffres clés

VL	23 018,23
12M VL max. (02.01.22)	23 025,73
12M VL min. (12.09.22)	22 941,14
Actif du compartiment (EUR mn.)	4 721,37
Première VL	200 000,00
Périodicité de calcul de la VL	Journalière

## Codes

Code ISIN	FR0010209916
Code Bloomberg	BNPEUPP FP

## Caractéristiques

Forme juridique	FCP (Fonds commun de placement) BNP PARIBAS SUSTAINABLE INVEST 3M de droit français
Nombre de part minimum initial	7
Éligible au PEA	Non
Éligible à une assurance-vie	Non
Indice de référence	Cash Index Euro Short Term Rate (EUR) RI 360 Days
Domiciliation	France
Date de lancement	07.08.2005
Gérant(s)	Elodie DERIEN
Société de gestion	BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France
Dépositaire	BNP PARIBAS
Devise de base	EUR
Catégorie AMF	1
Article SFDR	8



## GLOSSAIRE

### Sensibilité

Échelle de mesure de la sensibilité aux taux des obligations. Plus la durée résiduelle augmente, plus les cours obligataires réagissent à une modification des taux et plus la durée est élevée. La règle dit que si le taux remonte ou baisse de 1%, la valeur de l'obligation fluctue de 1% x la durée.

### VLC (valeur liquidative constante) lié à la dette publique

Un fonds monétaire VLC lié à la dette publique est un type de fonds défini dans le Règlement de l'Union Européenne sur les fonds monétaires, qui fait partie de la catégorie des fonds monétaires à court terme. La souscription et le remboursement des parts du fonds sont effectués à un prix constant, arrondi au point de pourcentage le plus proche.

### VLV (valeur liquidative à faible volatilité)

Un fonds monétaire VLV lié à la dette publique est un type de fonds défini dans le Règlement de l'Union Européenne sur les fonds monétaires, qui fait partie de la catégorie des fonds monétaires à court terme. La souscription et le remboursement des parts du fonds sont effectués à un prix constant, à condition que la valeur liquidative du fonds ne s'écarte pas de plus de 0,2% de la valeur nominale.

### VLV (valeur liquidative variable)

Les fonds VLV sont des fonds monétaires dont les investisseurs peuvent acheter ou se faire rembourser les parts à un prix découlant d'une valeur liquidative variable, calculée avec une précision de 4 décimales. Ils peuvent faire partie de la catégorie des fonds monétaires à court terme ou des fonds monétaires standards.

### 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).

### WAL (durée de vie moyenne pondérée)

La DVMP (durée de vie moyenne pondérée) d'un fonds monétaire est calculée de la même façon que la maturité moyenne pondérée (MMP), mais est fondée exclusivement sur les périodes restant à courir jusqu'à : (a) la date programmée de remboursement des titres détenus au portefeuille du fonds ou (b) leur date de remboursement à la demande du fonds, indépendamment de la date programmée de révision de leur taux d'intérêt.

### WAM (échéance moyenne pondérée)

Dans le cas des fonds monétaires, la maturité moyenne pondérée (MMP) est la moyenne des périodes restant à courir jusqu'à : (a) la date programmée de remboursement des titres détenus au portefeuille du fonds, (b) leur date de remboursement à la demande du fonds, ou (c) la date programmée de révision de leur taux d'intérêt en fonction des taux en vigueur sur le marché. Les titres à taux variable remboursables sur demande sont traités comme si leur date d'échéance était la plus rapprochée de ces deux dates si leur maturité programmée est inférieure ou égale à 397 jours, et la plus éloignée si leur maturité programmée est supérieure à 397 jours. La moyenne est pondérée par le pourcentage du coût amorti du portefeuille investi au cours de chaque période.

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](http://www.bnpparibas-am.com)

Le présent document a été rédigé et est publié par la société de gestion de portefeuille. Il contient des opinions et des données statistiques considérées légitimes et correctes le jour de leur publication conformément à l'environnement économique et financier en place à cette date. Le présent document ne constitue ni un conseil d'investissement, ni une invitation, ni une offre de souscription, ni une sollicitation d'achat de quelconque instrument financier et ne doit en aucun cas servir de base, en tout ou en partie, pour quelconque contrat ou engagement que ce soit.

Ces informations sont communiquées sans connaissance de la situation spécifique de l'investisseur. Avant toute souscription, les investisseurs devraient vérifier dans quels pays le ou les instruments financiers visés dans le présent document sont enregistrés et autorisés à la vente au public. En particulier, les instruments financiers ne peuvent être offerts ou vendus publiquement aux États-Unis. Il est conseillé aux investisseurs qui envisagent de souscrire de lire attentivement la version la plus récente du prospectus et du document d'information clé pour l'investisseur (DICI) approuvés par l'autorité compétente, disponible auprès du site web. Les investisseurs sont également invités à consulter les rapports financiers les plus récents, également disponibles sur le site web. Il est recommandé aux investisseurs de consulter leurs propres conseillers juridiques et fiscaux avant d'investir dans les instruments financiers. 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. Leur valeur est susceptible par nature de varier à la hausse comme à la baisse. En particulier, la valeur d'un investissement peut varier en fonction des fluctuations des taux de change. Les chiffres de performance sont communiqués après déduction des commissions de gestion et sont calculés sur la base de rendements globaux. Ils s'entendent facteur temporel, dividendes nets et intérêts réinvestis compris, mais n'incluent ni les taxes ou frais de souscription ou de rachat, ni les commissions ou taxes de change. Les performances passées ne constituent en rien une garantie pour les performances à venir.

La documentation visée par le présent avertissement est disponible sur [www.bnpparibas-am.com](http://www.bnpparibas-am.com)

