

OBJECTIF

Le présent document contient des informations essentielles sur le produit d'investissement. Il ne s'agit pas d'un document à caractère commercial. Ces informations vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste ce produit et quels risques, coûts, gains et pertes potentiels y sont associés, et de vous aider à le comparer à d'autres produits.

PRODUIT

BNP Paribas Easy S&P 500 Scored and Screened UCITS ETF, un compartiment de BNP PARIBAS Easy ICAV, action : UCITS ETF EUR Capitalisation (IE0004J37T45)

Initiateur : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe (« BNPP AM »)

Site Internet : <https://www.bnpparibas-am.com>

Numéro de téléphone : appelez le +33.1.58.97.13.09 pour de plus amples informations.

La Central Bank of Ireland ("CBI") est chargée de contrôler le Produit. BNPP AM est autorisé en France et réglementée par l'Autorité des marchés financiers (« AMF »).

Date de production du document d'informations clés : 03/03/2025

EN QUOI CONSISTE CE PRODUIT ?

Type

Ce produit est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM) qualifié de fonds indicial coté (ETF). Il est constitué sous la forme d'un compartiment de BNP PARIBAS Easy ICAV, une société d'investissement à capital variable (ICAV), répondant aux conditions de la loi irlandaise ainsi qu'aux dispositions de la directive OPCVM 2009/65/CE.

Durée

Ce Produit n'a pas de date d'échéance.

BNPP AM n'a pas le droit de mettre fin au Produit de manière unilatérale. L'assemblée générale des actionnaires de l'ICAV peut décider des opérations de fusion, scission et de liquidation du Produit. Le conseil d'administration de l'ICAV a le pouvoir de décider de résilier le produit dans des circonstances spécifiques telles que décrites dans le prospectus.

Objectifs

Objectif d'investissement : Le Compartiment (le « Fonds ») vise à répliquer la performance de l'indice S&P 500 Scored and Screened index NTR (Bloomberg : SPXESUN) (l'« Indice ») tout en visant à minimiser l'écart de suivi entre la valeur liquidative du Fonds et la performance de l'Indice.

Politique d'investissement : Le Fonds applique une stratégie de gestion passive (réplication d'indice). Afin d'atteindre son objectif d'investissement, le Fonds cherchera généralement à répliquer l'Indice en détenant tous les titres compris dans l'Indice dans une proportion similaire à leur pondération dans l'Indice (Réplication totale telle que définie dans le Prospectus). Le Fonds peut également utiliser la Réplication optimisée (telle que définie dans le Prospectus) et sélectionner des titres compris dans l'Indice afin de constituer un portefeuille représentatif offrant un rendement comparable à celui de l'Indice.

L'Indice est un indice pondéré en fonction de la capitalisation boursière flottante (calculé dividendes réinvestis après déduction des retenues à la source applicables) conçu pour mesurer la performance des titres répondant aux critères extra-financiers (environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG)), tout en maintenant une pondération globale similaire à celle de l'indice S&P 500. Les composants de l'Indice doivent faire partie de l'indice S&P 500 (l'« Univers éligible »). L'indice S&P 500 est un indice d'actions représentatif des 500 meilleurs titres par capitalisation boursière négociés aux États-Unis. L'Indice est rééquilibré sur une base annuelle.

L'Indice applique les exclusions de l'Univers éligible en fonction de l'implication des sociétés dans des activités commerciales spécifiques telles que, mais sans s'y limiter, les armes controversées, le charbon thermique ou le tabac, les activités non alignées aux principes du Pacte mondial des Nations Unies ou l'implication dans des controverses ESG pertinentes.

En outre, l'indice exclut les titres de l'Univers éligible (approche de « sélectivité ») selon une méthodologie best-in-class (un type de sélection ESG consistant à donner la priorité aux sociétés les mieux notées d'un point de vue extra-financier au sein de leur secteur d'activité, sans privilégier ni exclure un secteur donné par rapport à un univers ou un indice de référence).

La stratégie extra-financière de l'Indice, menée à chaque étape du processus d'investissement, peut comporter des limites méthodologiques telles que les Risques liés aux critères extra-financiers et aux investissements durables ou au rééquilibrage de l'Indice. La devise de référence du Fonds est le dollar américain. **Politique de distribution :** Les Administrateurs n'ont actuellement pas l'intention de déclarer des dividendes pour les Catégories identifiées comme « Capitalisation ».

Recommandation : Ce Fonds convient aux investissements à moyen et long terme, bien que le Compartiment puisse également convenir pour une stratégie d'exposition à court terme à l'Indice. Veuillez vous reporter au supplément du Fonds (le « Supplément ») pour obtenir plus de détails sur l'objectif et la politique d'investissement.

Investisseurs de détail visés

Ce Produit est conçu pour des investisseurs qui n'ont ni expertise financière ni connaissance spécifique pour comprendre le Produit, mais peuvent néanmoins supporter une perte totale du capital. Il est approprié pour des clients cherchant à accroître leur capital. Les investisseurs potentiels devraient avoir un horizon de placement d'au moins 5 années.

Informations pratiques

■ Dépositaire : BNP PARIBAS, Dublin Branch

■ Ce document d'informations clés décrit un compartiment de l'ICAV BNP PARIBAS Easy ICAV. De plus amples informations sur le Produit sont contenues dans le prospectus et les rapports périodiques qui sont publiés au niveau de l'ICAV. L'ICAV est structurée comme un fonds parapluie avec une responsabilité séparée entre les sous-fonds. L'acte constitutif prévoit que l'ICAV peut proposer des catégories d'actions distinctes, chacune représentant des intérêts dans un compartiment, chaque compartiment comprenant un portefeuille d'investissements distinct.

■ De plus amples informations sur le Produit, y compris le dernier prospectus, le document d'informations clés, les valeurs nettes d'inventaire, les derniers prix publiés des actions, le rapport périodique, la description de l'investissement, peuvent être obtenues gratuitement, en anglais, auprès de BNPP AM ou en ligne sur <https://www.bnpparibas-am.com>.



QUELS SONT LES RISQUES ET QU'EST-CE QUE CELA POURRAIT ME RAPPORTER ?

Indicateur de risque



L'indicateur de risque part de l'hypothèse que vous conservez le Produit 5 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.

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 5 sur 7, qui est une classe de risque entre moyenne et élevée. La catégorie de risque se justifie par l'investissement effectué principalement dans des Actions, dont la valeur peut fluctuer considérablement. Ces fluctuations sont souvent amplifiées à court terme.

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. Puisque la devise du produit est différente de celle du fonds, vous serez exposé aux fluctuations entre ces devises.

Ce Produit ne prévoyant pas de protection contre les aléas de marché, vous pourriez perdre tout ou partie de votre investissement.

Scénarios de performance

Les chiffres indiqués comprennent tous les coûts du Produit lui-même, mais pas nécessairement tous les coûts dus à votre conseiller ou distributeur. Ces chiffres ne tiennent pas compte de votre situation fiscale personnelle, qui peut également influencer sur les montants que vous recevrez. Ce que vous obtiendrez de ce Produit dépend des performances futures du marché. L'évolution future du marché est aléatoire et ne peut être prédite avec précision. Les scénarios défavorable, intermédiaire et favorable présentés représentent des exemples utilisant les meilleures et pires performances, ainsi que la performance moyenne du Produit et/ou de l'indice de référence approprié au cours des 10 dernières années. Les marchés pourraient évoluer très différemment à l'avenir. Le scénario de tensions montre ce que vous pourriez obtenir dans des situations de marché extrêmes.

Période de détention recommandée : 5 ans

Exemple d'investissement : 10.000 EUR

Si vous sortez après 1 an

Si vous sortez après 5 ans

Scénarios

Minimum	Il n'existe aucun rendement minimal garanti. Vous pourriez perdre tout ou une partie de votre investissement.		
Tensions	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	5.717,58 EUR	3.025,5 EUR
	Rendement annuel moyen	-42,82%	-21,27%
Défavorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	8.717,41 EUR	13.273,7 EUR
	Rendement annuel moyen	-12,83%	5,83%
Intermédiaire	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	11.308,3 EUR	19.959,38 EUR
	Rendement annuel moyen	13,08%	14,82%
Favorable	Ce que vous pourriez obtenir après déduction des coûts	14.482,57 EUR	22.791,93 EUR
	Rendement annuel moyen	44,83%	17,91%

Les scénarios ci-après se sont produits pour un investissement en utilisant un indice de référence approprié.

Le scénario favorable s'est produit pour un investissement entre 2016 et 2021.

Le scénario intermédiaire s'est produit pour un investissement entre 2016 et 2021.

Le scénario défavorable s'est produit pour un investissement entre 2023 et 2025.

QUE SE PASSE-T-IL SI BNPP AM N'EST PAS EN MESURE D'EFFECTUER LES VERSEMENTS ?

L'ICAV est constituée en tant qu'entité distincte de BNPP AM. En cas de défaillance de BNPP AM, les actifs du Produit/ICAV, détenus par un dépositaire, ne seraient pas affectés par cette défaillance.

En cas de défaillance du dépositaire, le risque de perte financière du Produit/ICAV est atténué par la séparation légale des actifs du dépositaire de ceux du Produit/ICAV.

QUE VA ME COÛTER CET INVESTISSEMENT ?

Il se peut que la personne qui vous vend ce Produit ou qui vous fournit des conseils à son sujet vous demande de payer des coûts supplémentaires. Si c'est le cas, cette personne vous informera au sujet de ces coûts et vous montrera l'incidence de ces coûts sur votre investissement. Si le Produit est utilisé dans le cadre d'un contrat d'assurance vie ou d'un contrat de capitalisation, les coûts présentés n'incluent pas les éventuels coûts liés à ces contrats.

Coûts au fil du temps

Les tableaux présentent les montants prélevés sur votre investissement afin de couvrir les différents types de coûts. Ces montants dépendent du montant que vous investissez et du temps pendant lequel vous détenez le Produit. Les montants indiqués ici sont des illustrations basées sur un exemple de montant d'investissement et différentes périodes d'investissement possibles.

Nous avons supposé :

■ qu'au cours de la première année, vous récupéreriez le montant que vous avez investi (rendement annuel de 0 %). Que pour les autres périodes de détention, le Produit évolue de la manière indiquée dans le scénario intermédiaire.

■ que 10.000 EUR sont investis.

	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Coûts totaux	14,89 EUR	149,07 EUR
Incidence des coûts annuels (*)	0,15%	0,17% chaque année



(*) Elle montre dans quelle mesure les coûts réduisent annuellement votre rendement au cours de la période de détention. Par exemple, elle montre que si vous sortez à la fin de la période de détention recommandée, il est prévu que votre rendement moyen par an soit de 14,99% avant déduction des coûts et de 14,82% après cette déduction.

Composition des coûts

Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie	Si vous sortez après 1 an	
Coûts d'entrée (*)	Nous ne facturons pas de coût d'entrée pour ce Produit.	0 EUR
Coûts de sortie (*)	Nous ne facturons pas de coût de sortie pour ce Produit.	0 EUR
Coûts récurrents prélevés chaque année		
Frais de gestion et autres frais administratifs et d'exploitation	0,13% de la valeur de votre investissement par an. Le montant est basé sur les coûts passés calculés au 31/12/2024.	13 EUR
Coûts de transaction	0,01% de la valeur de votre investissement par an. Il s'agit d'une estimation des coûts encourus lorsque nous achetons et vendons les investissements sous-jacents au Produit. Le montant réel peut varier. Ce chiffre est donc indicatif et pourra faire l'objet d'une révision à la hausse comme à la baisse.	1,89 EUR
Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions		
Commissions liées aux résultats	Aucune commission liée aux résultats n'existe pour ce Produit.	0 EUR

(*) Nous ne facturons pas de frais d'entrée ou de sortie sur le marché secondaire. Les investisseurs de détail qui ne sont ni des participants autorisés ni des investisseurs autorisés ne pourront en effet généralement acheter ou vendre des parts ou actions que sur le marché secondaire où des parts ou actions du Produit sont négociées avec l'aide d'un intermédiaire (par exemple un courtier). Dans ce cas, ces investisseurs peuvent engager des frais et des coûts qui sont payables à l'intermédiaire mais qui ne sont pas facturés par le produit lui-même ou son initiateur. Vous pouvez le savoir auprès de votre conseiller financier. Il est à noter que le prospectus décrit les coûts maximum applicables sur le marché primaire, généralement pour les participants autorisés et les investisseurs autorisés et/ou dans des circonstances exceptionnelles.

En cas de conversion, aucune commission ne sera imputée.

COMBIEN DE TEMPS DOIS-JE LE CONSERVER, ET PUIS-JE RETIRER DE L'ARGENT DE FAÇON ANTICIPÉE ?

Période de détention recommandée : 5 ans.

La période de détention recommandée a été définie et se base sur le profil de risque et de rémunération du Produit.

Les investisseurs peuvent demander le rachat de leurs actions sur une base quotidienne (les jours ouvrés bancaires), comme indiqué dans le prospectus.

Tout rachat effectué avant la fin de la période de détention recommandée peut avoir un impact négatif sur le profil de performance du Produit et sur le profil de risque.

COMMENT PUIS-JE FORMULER UNE RECLAMATION ?

Pour toute réclamation, vous êtes invité à contacter votre Gestionnaire des relations clients habituel qui vous a conseillé le Produit. Vous pouvez également contacter BNPP AM, comme décrit sur le site Internet <https://www.bnpparibas-am.fr> (Note de bas de page « Politique de gestion des réclamations »), en écrivant à BNPP AM - Service client - SA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX.

AUTRES INFORMATIONS PERTINENTES

■ Afin d'accéder aux performances passées et aux scénarios de performance du Produit, veuillez suivre les instructions ci-dessous :

(1) Cliquez sur <https://www.bnpparibas-am.fr> (2) Sur la page d'accueil, choisissez « France » et sélectionnez la langue souhaitée ainsi que votre profil d'investisseur ; acceptez les termes et conditions du site Internet (3) Allez dans l'onglet « NOS FONDS » et « Recherche de fonds » (4) Recherchez le Produit à l'aide du code ISIN ou du nom du Produit et cliquez sur le Produit (5) Cliquez sur l'onglet « Performances ».

■ Le diagramme sur le site internet affiche la performance du Produit en pourcentage de perte ou de gain au cours de la dernière année par rapport à son indice de référence. Il peut vous aider à évaluer comment le Produit a été géré dans le passé et à le comparer à son indice de référence.

