

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 INDICE USA, Part Classic H (FR0012722882)

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.

L'Autorité des marchés financiers (« AMF ») est chargée du contrôle de BNPP AM en ce qui concerne ce document d'informations clés.

BNPP AM est agréée en France sous le n°GP96002 et réglementée par l'AMF.

Date de production du document d'informations clés : 31/03/2025

EN QUOI CONSISTE CE PRODUIT ?

Type

Ce Produit est un organisme de placement collectif en valeurs mobilières (OPCVM). Il est constitué sous forme de fonds commun de placement (FCP) soumis aux dispositions du code monétaire et financier et à la directive OPCVM 2009/65/CE modifiée.

Durée

Ce Produit a été initialement créé pour une durée de 99 ans.

BNPP AM a le droit de procéder à la dissolution du Produit de manière unilatérale. La dissolution peut également intervenir en cas de fusion, de rachat total des parts ou lorsque l'actif net du Produit est inférieur au montant minimum réglementaire.

Objectifs

Objectif de gestion : De classification Actions internationales, BNP PARIBAS INDICE USA a pour objectif de gestion de répliquer la performance de l'indice S&P 500 Scored and Screened (EUR) (Net Total Return), quelle que soit son évolution à la hausse comme à la baisse, avant prélèvement des frais. Le FCP étant indiciel, il a pour objectif de maintenir l'écart de suivi en valeur absolue entre l'évolution de la valeur liquidative du FCP et celle de l'indice à un niveau inférieur à 1%. Si cet écart de suivi dépasse 1%, il ne devra en tout état de cause pas dépasser 5% de la volatilité de l'indice. L'écart de suivi est calculé à partir des performances hebdomadaires observées sur les cinquante-deux (52) dernières semaines.

Caractéristiques essentielles du Produit : L'indicateur de référence du Produit est l'indice S&P 500 Scored and Screened (EUR) (Net Total Return), calculé dividendes nets réinvestis (code Bloomberg : SPXESUN). L'indice S&P 500 Scored and Screened prend pour univers d'investissement éligible tous les titres qui composent son indice parent, le S&P 500®. Il peut également utiliser une réplication optimisée et sélectionner des titres compris dans son indice parent afin de constituer un portefeuille représentatif offrant un rendement comparable à celui de son indice parent. L'indice S&P 500 Scored and Screened 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 tenant compte de critères extra-financiers, tout en maintenant une pondération globale similaire à celle de son indice parent, le S&P 500, indice d'actions représentatif des 500 meilleurs titres par capitalisation boursière négociés aux États-Unis. L'Indice S&P 500 Scored and Screened est rééquilibré sur une base annuelle. L'actif du Produit est composé de titres de sociétés de tous secteurs, de grande et éventuellement moyenne capitalisation, émis sur les marchés d'un ou de plusieurs pays européens et dont la performance est destinée à être échangée contre une indexation à l'indicateur de référence. Pour la gestion de sa trésorerie et/ou en fonction des conditions de marché, le Produit peut investir en instruments du marché monétaire (Bons du Trésor Français, titres négociables à court terme) ou en titres de créance négociables. Les instruments de taux obligataires et/ou monétaires bénéficient lors de leur acquisition d'une notation minimale A-3 (Standard & Poor's) ou P-3 (Moody's) ou, à défaut, d'une notation « long term investment grade » ou d'une notation interne à la société de gestion qui répond à des critères équivalents. Le Produit s'expose à la performance de l'indice au travers d'un contrat financier (méthode de réplication synthétique).

Le Produit est éligible au plan d'épargne en actions (PEA) et, en conséquence, maintient dans ses actifs au moins 75% de titres éligibles au PEA.

Le risque de change est couvert par l'utilisation de contrats à terme sur devises et de change à terme. Le Produit aura recours à des instruments dérivés tels que les futures et les options sur actions, indices boursiers et devises et des achats/ventes de devises à terme. L'ensemble de ces derniers instruments sera utilisé pour ajuster les risques actions et/ou de change.

Pour obtenir plus de détails, il est conseillé de se reporter au prospectus du Produit.

Les porteurs peuvent demander le rachat de leurs parts du lundi au vendredi jusqu'à 13 heures (heure de Paris). Les demandes de rachat sont exécutées sur la base de la prochaine valeur liquidative datée du même jour, réglées dans les cinq jours suivant la date de calcul de la valeur liquidative.

Affectation du résultat net et des plus-values nettes réalisées : Capitalisation.

Autres informations : Le Produit pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant cinq ans.

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. Le Produit n'est pas commercialisé auprès des investisseurs américains entrant dans la définition de restricted person telle que résumée dans le prospectus du Produit.

Informations pratiques

■ Dépositaire : BNP PARIBAS

■ Le prospectus, les documents d'informations clés relatifs aux autres parts de ce Produit, la valeur liquidative, les derniers documents annuels et périodiques rédigés en langue française du Produit, sont disponibles sur le site internet www.bnpparibas-am.com. Ils peuvent être adressés gratuitement sur simple demande écrite auprès de : BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX France.



DOCUMENT D'INFORMATIONS CLÉS

3 / 3

- que 10.000 EUR sont investis.

	Si vous sortez après 1 an	Si vous sortez après 5 ans
Coûts totaux	261,22 EUR	833,21 EUR
Incidence des coûts annuels (*)	2,62%	1,19% 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 16,08% avant déduction des coûts et de 14,89% après cette déduction. Il se peut que nous partagions les coûts avec la personne qui vous vend le Produit afin de couvrir les services qu'elle vous fournit. Cette personne vous informera du montant.

Composition des coûts

Coûts ponctuels à l'entrée ou à la sortie	Si vous sortez après 1 an	
Coûts d'entrée	Jusqu'à 2,00% du montant que vous payez au moment de l'entrée dans l'investissement.	Jusqu'à 200 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	0,62% de la valeur de votre investissement par an. Le montant est basé sur les coûts passés calculés au 31/12/2024.	60,76 EUR
Coûts de transaction	0,005% 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.	0,46 EUR
Coûts accessoires prélevés sous certaines conditions		
Commissions liées aux résultats	Aucune commission liée aux résultats n'existe pour ce Produit.	0 EUR

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 parts sur la base de la valeur liquidative dont les détails figurent 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. Le Produit a un dispositif de plafonnement des rachats de parts permettant de reporter les demandes de rachat dans des circonstances exceptionnelles et selon les conditions détaillées dans le prospectus du Produit.

COMMENT PUIS-JE FORMULER UNE RECLAMATION ?

Pour toute réclamation, l'investisseur est invité à se rapprocher de son conseiller habituel auprès de l'établissement qui lui a conseillé le Produit. Il peut également s'adresser à BNPP AM via son site www.bnpparibas-am.fr (rubrique: « Politique de traitement des réclamations clients » en pied de page) ou adresser un courrier recommandé avec AR à BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe - Service Client - TSA 90007 - 92729 Nanterre CEDEX, ou en envoyant un courriel à amfr.reclamations@bnpparibas.com.

AUTRES INFORMATIONS PERTINENTES

- Afin d'accéder aux performances et scénarios de performance passées du Produit, veuillez suivre les instructions ci-dessous :
(1) Cliquez sur <https://www.bnpparibas-am.fr> (2) Dans la page d'accueil, allez dans « 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 par an au cours des 9 dernières années 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.
- Lorsque ce Produit est utilisé comme support en unité de compte d'un contrat d'assurance sur la vie ou de capitalisation, les informations complémentaires sur ce contrat, telles que les coûts du contrat, qui ne sont pas compris dans les coûts indiqués dans le présent document, le contact en cas de réclamation et ce qui se passe en cas de défaillance de l'entreprise d'assurance sont présentées dans le document d'informations clés de ce contrat obligatoirement remis par votre assureur ou courtier ou tout autre intermédiaire d'assurance conformément à son obligation légale.
- Les critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) contribuent à la prise de décision du gérant, sans pour autant être un facteur déterminant de cette prise de décision.
- Le Produit relève de l'article 8 du règlement dit SFDR (Sustainable Finance Disclosure Regulation - règlement 2019/2088 du Parlement Européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers). Les informations relatives à la finance durable sont disponibles à l'adresse suivante : <https://www.bnpparibas-am.com/fr/sustainability-bnpp-am/>.
- Ce Produit a recours à un mécanisme de valeur liquidative ajustée ou *swing pricing* dont les dispositions sont définies dans son prospectus.
- L'investisseur peut avoir recours au Médiateur de l'AMF par courrier postal : Le Médiateur - Autorité des marchés financiers - 17, place de la Bourse - 75082 Paris CEDEX 02 ou internet : <http://www.amf-france.org> rubrique : Le Médiateur.



**BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT**

L'investisseur durable d'un monde qui change