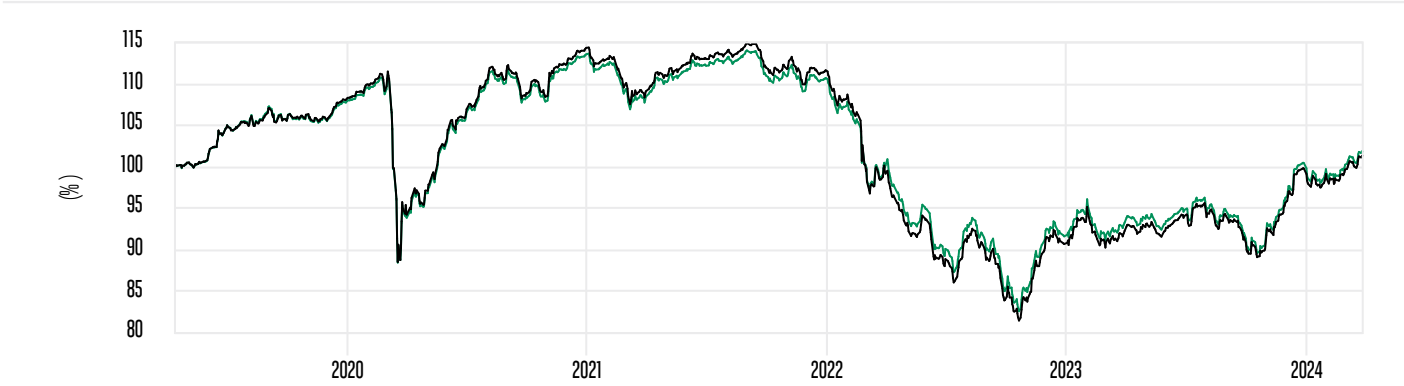


TABLA RESUMEN A 28.03.2024

| Clase de Activo                                                                                 | Indice de Referencia                  | No. de Posiciones del benchmark         | Tamaño del Fondo (USD millones) |
|-------------------------------------------------------------------------------------------------|---------------------------------------|-----------------------------------------|---------------------------------|
| Renta fija                                                                                      | Índice de Referencia Compuesto*       | 765                                     | 827                             |
| Perfil de Riesgo y Remuneración                                                                 | Rendimiento en el Año en Curso (1)    | Rend. Anualizado a 3 años (2)           | Calificación Morningstar        |
| <div><div>1</div><div>2</div><div>3</div><div>4</div><div>5</div><div>6</div><div>7</div></div> | 1,41 %<br>Índice de Referencia 1,53 % | -1,91 %<br>Índice de Referencia -2,28 % | ★ ★ ★ ★ ☆<br>31.03.2024         |

\* JPM ESG EMBI Global Diversified Composite (TR) index (Bloomberg: JESGEMGD index)  
(2) Basado en 360 días

RENDIMIENTO (ACUMULADO A 5 AÑOS) (USD)



Rendimiento Acumulado a 28.03.2024 (en %)

|                        | Año en curso | 1 Mes | 3 Meses | 6 Meses | 1 Año | 2 Años | 3 Años | 4 Años | 5 Años |
|------------------------|--------------|-------|---------|---------|-------|--------|--------|--------|--------|
| ● FONDO                | 1,41         | 1,93  | 1,41    | 10,65   | 9,18  | 1,95   | -5,70  | 7,18   | 1,79   |
| ● INDICE DE REFERENCIA | 1,53         | 1,97  | 1,53    | 10,69   | 9,81  | 1,92   | -6,76  | 6,21   | 1,31   |

Rendimiento Anual a 28.03.2024 (en %)

|                        | 2023  | 2022   | 2021  | 2020 | 2019  | 2018  | 2017  | 2016  | 2015 | 2014 |
|------------------------|-------|--------|-------|------|-------|-------|-------|-------|------|------|
| ● FONDO                | 9,63  | -17,24 | -2,53 | 5,40 | 14,75 | -4,50 | 9,00  | 9,30  | 0,30 | 7,10 |
| ● INDICE DE REFERENCIA | 10,06 | -18,78 | -2,35 | 5,78 | 15,56 | -4,30 | 10,30 | 10,20 | 1,20 | 7,40 |

(1) Todos los datos son netos de comisiones (en USD en Track I, Capitalización). La rentabilidad histórica o el logro no es indicativo de los resultados actuales o futuros.  
05/2011-02/2016: Tras una acción corporativa el 26/02/2016, las rentabilidades enumeradas son las del subfondo PARWORLD TRACK EMERGING MARKETS BOND.  
02/2016-09/2019: Durante este periodo, el índice de referencia fue «JPM EMBI Global Diversified Composite (TR)».  
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 %)

Principales Posiciones (%)

|                                           |            |
|-------------------------------------------|------------|
| URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 5.10 PCT   | 0,88       |
| POLAND (REPUBLIC OF) 5.50 PCT 18-MAR-2054 | 0,76       |
| KUWAIT STATE OF (GOVERNMENT) 3.50 PCT     | 0,74       |
| ECUADOR REPUBLIC OF (GOVERNMENT) 3.50     | 0,67       |
| POLAND (REPUBLIC OF) 5.13 PCT 18-SEP-2034 | 0,66       |
| ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT 3.63     | 0,62       |
| ARGENTINA REPUBLIC OF GOVERNMENT 0.75     | 0,60       |
| URUGUAY (ORIENTAL REPUBLIC OF) 4.98 PCT   | 0,56       |
| REPUBLIC OF POLAND 5.50 PCT 04-APR-2053   | 0,56       |
| HUNGARY (GOVERNMENT) 5.50 PCT             | 0,56       |
| <b>No. of Holdings in Benchmark</b>       | <b>765</b> |

Desglose por País (benchmark) (%)

|                        |               |
|------------------------|---------------|
| Arabia Saudí           | 5,41          |
| Indonesia              | 4,65          |
| Emiratos Árabes Unidos | 4,49          |
| Hungría                | 4,23          |
| Rumanía                | 3,98          |
| Chile                  | 3,83          |
| Brasil                 | 3,80          |
| Omán                   | 3,68          |
| Qatar                  | 3,64          |
| Filipinas              | 3,63          |
| Otros                  | 58,65         |
| <b>Total</b>           | <b>100,00</b> |

by Rating (benchmark) (%)

|                  |               |
|------------------|---------------|
| AA               | 6,14          |
| A+               | 6,87          |
| BBB+             | 4,28          |
| BBB              | 19,28         |
| BBB-             | 8,00          |
| BB+              | 10,57         |
| BB               | 5,24          |
| BB-              | 9,80          |
| B+               | 5,53          |
| Otros            | 23,73         |
| Sin calificación | 0,56          |
| <b>Total</b>     | <b>100,00</b> |

Datos: BNP Paribas Asset Management, a 28.03.2024  
Fuentes: Fitch, Moody's, S&P. Las calificaciones inferiores a BBB- hacen referencia a los bonos high-yield o bonos especulativos  
Los datos de las fichas mensuales se calculan empleando datos contables oficiales calculados en base a la fecha de negociación.



Bench. puntuación global ESG  
**45,42**

INDICADORES DE SOSTENIBILIDAD

CONTRIBUCIONES ESG

|           | Contribución medioambiental | Contribución social | Contribución de buen gobierno |
|-----------|-----------------------------|---------------------|-------------------------------|
| Benchmark | -0,70                       | -1,39               | -2,48                         |

INDEX COVERAGE

|               | Cobertura |
|---------------|-----------|
| Cobertura ESG | 96,00 %   |

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 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 respeto 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

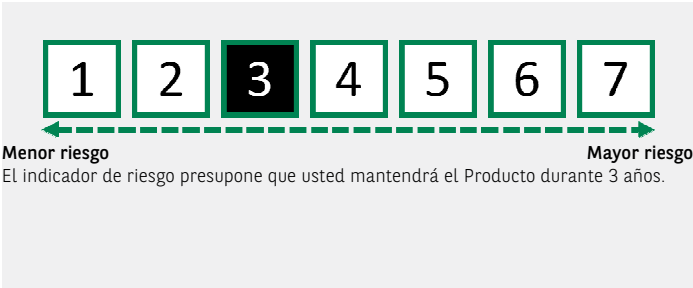
En un índice reproducido por el fondo la cobertura representa el porcentaje de valores con una puntuación ESG o huella de carbono empleando la metodología interna de BNP Paribas Asset Management del total de valores elegibles para tener tal puntuación ESG o huella de carbono. Como tal, esta puede ser inferior a la cobertura plena ofrecida por el proveedor del índice.

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/>



RIESGO

Perfil de Riesgo y Remuneración



Análisis de Riesgo (3 años, mensual)

|                                      | Fondo |
|--------------------------------------|-------|
| Volatilidad                          | 10,62 |
| Error de Seguimiento                 | 0,77  |
| Duración Modificada (28.03.2024)     | 6,91  |
| Rent. Hasta Vencimiento (28.03.2024) | 6,69  |
| Cupón medio                          | 5,20  |
| Duration                             | 6,91  |

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        | 0,00% |
| Comisiones Máx. por Rescate (28.03.24) | 0,00% |
| Comisiones de Conversión máx.          | 0,00% |
| Gastos Corrientes (31.12.23)           | 0,20% |
| Comisiones Máx. de Admin.              | 0,07% |

Index data as of 31.03.2024

|                  |                                                    |
|------------------|----------------------------------------------------|
| Name             | JPM ESG EMBI Global Diversified Composite (USD) RI |
| Código Bloomberg | JPGCCOMP                                           |
| Código Reuters   | JPMEGDR                                            |

Códigos

|                  |              |
|------------------|--------------|
| Código ISIN      | LU1291092200 |
| Código Bloomberg | JPMGDTI LX   |

Datos Clave

|                                       |            |
|---------------------------------------|------------|
| Valor Liquidativo (VL)                | 144.750,81 |
| Tamaño del Fondo (Dólar USA millones) | 826,60     |

Características

|                                    |                                                                                  |
|------------------------------------|----------------------------------------------------------------------------------|
| Forma Legal                        | Domicilio SICAV BNP PARIBAS EASY de derecho Luxemburgués                         |
| Horizonte de Inversión Recomendado | 3                                                                                |
| Índice de Referencia               | JPM ESG EMBI Global Diversified Composite (TR) index (Bloomberg: JESGEMGD index) |
| Domicilio                          | Luxemburgo                                                                       |
| Fecha de Apertura                  | 26.02.2016                                                                       |
| Gestor                             | Mohamed Fadil HANNANE                                                            |
| Compañía Operadora                 | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg                                          |



Características

|                             |                                                                       |
|-----------------------------|-----------------------------------------------------------------------|
| Gestora Delegada            | BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe                                   |
| Depositorio                 | BNP PARIBAS, Luxembourg Branch                                        |
| Divisa Base                 | USD                                                                   |
| Subscription/execution type | VL + 2                                                                |
| Artículo SFDR               | Artículo 8 - Promoción de características medioambientales o sociales |



## GLOSARIO

**Duración Modificada**

Una escala de la sensibilidad de los bonos a variaciones en los tipos de interés. Cuanto mayor sea el vencimiento residual, más reaccionarán los precios de los bonos a una variación en los tipos de interés, y más alta será la duración. La regla es que si el tipo sube o baja en un 1%, el valor del bono fluctuará en un 1% x la duración.

**Rent. Hasta Vencimiento**

Un cálculo de rendimiento que tiene en cuenta la relación entre el valor al vencimiento de un título, el plazo de vencimiento, el precio actual y el rendimiento por cupones.

**Error de Seguimiento**

El error de seguimiento mide la volatilidad del rendimiento relativo de una cartera en relación con su índice de referencia.

**Volatilidad**

La volatilidad de un activo es la desviación típica de su rendimiento. En cuanto medida de dispersión, valora la incertidumbre de los precios de los activos, lo que a menudo se asimila a su riesgo. La volatilidad puede calcularse ex post (retrospectivamente) o estimarse ex ante (anticipativamente).

**Cupón medio**

Importe medio de los cupones pagados durante el periodo.

**Duración**

La duración de un bono es una medida de tiempo (en años) que expresa el vencimiento medio ponderado de todos los flujos de caja de los bonos actualizados.

Puede consultar un glosario de los términos financieros que aparecen en este documento en el sitio web <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)

**Descargo de Morningstar:**

Copyright © 2023 Morningstar, Inc. Reservados todos los derechos. La calificación global de cada fondo se basa en la media ponderada del número de estrellas que le hayan sido asignadas durante períodos de calificación de 3, 5 y 10 años. La información contenida en el presente: (1) es propiedad de Morningstar y/o de sus proveedores de contenidos; (2) no puede copiarse ni distribuirse; y (3) no se garantiza que sea exacta, esté completa o que sea oportuna. Ni Morningstar ni sus proveedores de contenidos son responsables de los daños o pérdidas que pudieran derivarse del uso de esta información. Los resultados obtenidos en el pasado no garantizan resultados futuros.

