

PERCENTUALE MEDIA WHITE LIST E ASSIMILATI DELLE SICAV DI DIRITTO LUSSEMBURGHESE DI BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT

II Semestre 2018



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

L'asset manager
per un mondo
che cambia



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

A tutti i soggetti interessati

Lussemburgo, 11 giugno 2018

OGGETTO: Identificazione percentuale titoli di stato e white list presenti nel portafoglio degli OICR ai fini dell'applicazione D.L. 13 agosto 2011 n. 138 convertito con modificazioni dalla L. 14 settembre 2011 n. 148.

In allegato vi trasmettiamo i prospetti riepilogativi contenenti l'indicazione delle percentuali necessarie per la determinazione della base imponibile di cui al D.L. in oggetto per gli OICR di diritto Lussemburghese gestiti dalla scrivente Società e relativi ai seguenti fondi/sicav:

- PARVEST
- BNP PARIBAS L1
- BNP PARIBAS PLAN
- BNP PARIBAS EASY
- PARWORLD
- BNPP Lussemburgo - Altri OICR di diritto lussemburghese

Le suddette percentuali sono state calcolate sulla base delle ultime due situazioni contabili semestrali/annuali disponibili dei singoli OICR e sono da utilizzare ai fini dell'applicazione del D.L. in oggetto nel periodo 1° luglio 2018/31 dicembre 2018.

Cordiali saluti,

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg S.A.

Nome: S. Brunet
Carica: C.E.O.

Nome: S. Baijot
Carica: Deputy C.E.O. Head of operational Control
and Client Service

Nome del fondo	Data dell'ultimo rendiconto annuale	Data dell'ultimo rendiconto semiannuale	PERCENTUALE MEDIA WHITE LIST E ASSIMILATI	Data di valenza della percentuale	Data di fine valenza della percentuale
BNP PARIBAS A FUND European Multi-Asset Income	31/03/2018	29/09/2017	10.57%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS COMFORT BOND FUND	31/07/2017	31/01/2018	30.04%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS GLOBAL BOND FUND	30/09/2017	29/03/2018	62.87%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS INSTICASH MONEY 3M EUR	31/05/2018	30/11/2017	0.84%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS LI PATRIMOINE	31/12/2017	30/06/2017	15.53%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 0-10 Y EURO P	31/12/2017	30/06/2017	81.04%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 10-15 Y EURO P	31/12/2017	30/06/2017	81.48%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 10-20 Y EURO P	31/12/2017	30/06/2017	84.56%	01/07/2018	31/12/2018

BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 20-25 Y EURO P	31/12/2017	30/06/2017	97.23%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 25-35 Y EURO P	31/12/2017	30/06/2017	99.13%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 35-50 Y EURO P	31/12/2017	30/06/2017	100.00%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING ALL MATURITIES - EUR	31/12/2017	30/06/2017	78.13%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS PLAN INTERNATIONA L DERIVATIVES	31/10/2017	30/04/2018	59.34%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND HIGH VOL	30/09/2017	29/03/2018	16.56%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND VERY HIGH VOL	30/09/2017	29/03/2018	6.76%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS EASY BARCLAYS EURO GOVERNMENT INFLATION LINKED ALL MATURITIES	31/12/2017	30/06/2017	99.68%	01/07/2018	31/12/2018

BNP PARIBAS EASY ENERGY & METALS ENHANCED ROLL	31/12/2017	30/06/2017	47.23%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS EASY JPM EMBI GLOBAL DIVERSIFIED COMPOSITE	31/12/2017	30/06/2017	60.69%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS EASY JPM GBI EMU	31/12/2017	30/06/2017	99.75%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS EASY JPM GBI GLOBAL EX EMU HEDGED EUR	31/12/2017	30/06/2017	98.88%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS FLEXI I BOND ASIA INVESTMENT GRADE	30/06/2017	29/12/2017	6.84%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS FLEXI I BOND GOVERNMENT EURO RESTRICTED	30/06/2017	29/12/2017	96.56%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS FLEXI I US MORTGAGE	30/06/2017	29/12/2017	2.30%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS FLEXI III EURO GOVERNMENT LONG-DATE PASSIVE BOND FUND	31/12/2017	30/06/2017	100.00%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS FORTIGO SUSTAINABLE ALLOCATION	31/12/2017	30/06/2017	6.43%	01/07/2018	31/12/2018

BNP PARIBAS L1 CONVERTIBLE BOND WORLD	31/12/2017	30/06/2017	3.49%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 BOND EURO CORPORATE	31/12/2017	30/06/2017	0.00%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 BOND EUROPE PLUS	31/12/2017	30/06/2017	51.15%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 BOND WORLD EMERGING LOCAL	31/12/2017	30/06/2017	89.34%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 BOND WORLD PLUS	31/12/2017	30/06/2017	26.90%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 CONVERTIBLE BOND BEST SELECTION EUROPE	31/12/2017	30/06/2017	0.01%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 MULTI-ASSET INCOME	31/12/2017	30/06/2017	8.41%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 SUSTAINABLE ACTIVE BALANCED	31/12/2017	30/06/2017	17.33%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 SUSTAINABLE ACTIVE GROWTH	31/12/2017	30/06/2017	7.66%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS L1 SUSTAINABLE ACTIVE STABILITY	31/12/2017	30/06/2017	33.97%	01/07/2018	31/12/2018

BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2018	31/10/2017	30/04/2018	0.75%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2021	31/10/2017	30/04/2018	6.07%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2023	31/10/2017	30/04/2018	2.62%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2026	31/10/2017	30/04/2018	2.62%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND LOW VOL	30/09/2017	29/03/2018	16.04%	01/07/2018	31/12/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND MEDIUM VOL	30/09/2017	29/03/2018	19.00%	01/07/2018	31/12/2018
FLEXIFUND PRIVATE OPTIMISED MANAGEMENT	31/12/2017	30/06/2017	74.00%	01/07/2018	31/12/2018
FLEXIFUND SHORT TERM RMB	31/12/2017	30/06/2017	95.74%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND ABSOLUTE RETURN V350	31/12/2017	30/06/2017	14.52%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND ABSOLUTE RETURN V700	31/12/2017	30/06/2017	32.62%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND ASIA EX-JAPAN	31/12/2017	30/06/2017	8.95%	01/07/2018	31/12/2018

PARVEST BOND BEST SELECTION WORLD EMERGING	31/12/2017	30/06/2017	57.49%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND EURO	31/12/2017	30/06/2017	63.19%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND EURO GOVERNMENT	31/12/2017	30/06/2017	84.47%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND EURO INFLATION- LINKED	31/12/2017	30/06/2017	97.21%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND EURO LONG TERM	31/12/2017	30/06/2017	93.11%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND EURO MEDIUM TERM	31/12/2017	30/06/2017	49.20%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND EURO SHORT TERM	31/12/2017	30/06/2017	53.67%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND JPY	31/12/2017	30/06/2017	91.53%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND RMB	31/12/2017	30/06/2017	41.68%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND USD	31/12/2017	30/06/2017	10.29%	01/07/2018	31/12/2018

PARVEST BOND USD SHORT DURATION	31/12/2017	30/06/2017	41.40%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND WORLD	31/12/2017	30/06/2017	32.41%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND WORLD EMERGING	31/12/2017	30/06/2017	48.61%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND WORLD EMERGING LOCAL	31/12/2017	30/06/2017	83.25%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND WORLD INCOME	31/12/2017	30/06/2017	0.01%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST BOND WORLD INFLATION- LINKED	31/12/2017	30/06/2017	93.96%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST CONVERTIBLE BOND EUROPE SMALL CAP	31/12/2017	30/06/2017	0.00%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST CONVERTIBLE BOND ASIA	31/12/2017	30/06/2017	3.25%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST CONVERTIBLE BOND EUROPE	31/12/2017	30/06/2017	3.87%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST CONVERTIBLE BOND WORLD	31/12/2017	30/06/2017	0.16%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST COVERED BOND EURO	31/12/2017	30/06/2017	4.65%	01/07/2018	31/12/2018

PARVEST CROSS ASSET ABSOLUTE RETURN	31/12/2017	30/06/2017	8.39%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST DIVERSIFIED DYNAMIC	31/12/2017	30/06/2017	12.46%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST ENHANCED CASH 6 MONTHS	31/12/2017	30/06/2017	5.19%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST FLEXIBLE BOND EURO	31/12/2017	30/06/2017	64.56%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST FLEXIBLE BOND EUROPE CORPORATE	31/12/2017	30/06/2017	0.02%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST FLEXIBLE MULTI-ASSET	31/12/2017	30/06/2017	7.83%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST GREEN BOND	31/12/2017	30/06/2017	29.17%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST MONEY MARKET EURO	31/12/2017	30/06/2017	3.22%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST MULTI-ASSET INCOME EMERGING	31/12/2017	30/06/2017	33.32%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST SUSTAINABLE BOND EURO	31/12/2017	30/06/2017	49.61%	01/07/2018	31/12/2018
PARVEST SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE	31/12/2017	30/06/2017	0.16%	01/07/2018	31/12/2018

PARVEST SUSTAINABLE BOND WORLD CORPORATE	31/12/2017	30/06/2017	0.15%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD CHAMPIONS - EUROPA	30/09/2017	29/03/2018	32.97%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD CHAMPIONS - MONDO GENIUS & RELAX	30/09/2017	29/03/2018	42.69%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD CHAMPIONS - MONDO PMI	30/09/2017	29/03/2018	35.04%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD CHAMPIONS - MONDO PMI 2	30/09/2017	29/03/2018	35.91%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD FLEXIBLE CONVERTIBLE BOND	30/09/2017	29/03/2018	0.00%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD LYRA	30/09/2017	29/03/2018	2.29%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD MULTI-ASSET BOOSTER	30/09/2017	29/03/2018	73.03%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD TRACK EMU GOVERNMENT BOND 1-10 YEARS	30/09/2017	29/03/2018	99.88%	01/07/2018	31/12/2018
PARWORLD TRACKER MACRO OPPORTUNITIES	30/09/2017	29/03/2018	3.33%	01/07/2018	31/12/2018