

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

I Semestre 2018



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

L'asset manager
per un mondo
che cambia



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

A tutti i soggetti interessati

Lussemburgo, 12 dicembre 2017

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° gennaio 2018/30 giugno 2018.

Cordiali saluti,

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg S.A.



Stéphane BRUNET
Chief Executive Officer
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg

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 semi-annuale	Data dell'ultimo rendiconto annuale	PERCENTUAL E MEDIA WHITE LIST E ASSIMILATI	Data di inizio valenza della percentuale	Data di fine valenza della percentuale
BNP PARIBAS A FUND EUROPEAN MULTI-ASSET INCOME	29/09/2017	31/03/2017	9.02%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS COMFORT BOND FUND	31/01/2017	31/07/2017	37.02%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS EASY BARCLAYS EURO GOVERNMENT INFLATION LINKED ALL MATURITIES	30/06/2017	31/12/2016	99,77%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS EASY ENERGY & METALS ENHANCED ROLL	30/06/2017	31/12/2016	95,84%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS EASY JPM EMBI GLOBAL DIVERSIFIED COMPOSITE	30/06/2017	31/12/2016	60,39%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS EASY JPM GBI EMU	30/06/2017	31/12/2016	99,71%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS EASY JPM GBI GLOBAL EX EMU HEDGED EUR	30/06/2017	31/12/2016	98,74%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS FLEXI I BOND GOVERNMENT EURO RESTRICTED	30/12/2016	30/06/2017	94,62%	01/01/2018	30/06/2018

BNP PARIBAS FLEXI I US MORTGAGE	31/12/2016	30/06/2017	3,63%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS FLEXI I US MORTGAGE CLASSIC MD DISTRIBUTION	31/12/2016	30/06/2017	3,63%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS FLEXI I US MORTGAGE IH CHF DISTRIBUTION	31/12/2016	30/06/2017	3,63%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS FLEXI I US MORTGAGE IH GBP DISTRIBUTION	31/12/2016	30/06/2017	3,63%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS FLEXI III EURO GOVERNMENT LONG-DATED PASSIVE BOND FUND	30/06/2017	31/12/2016	100,00%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS FLEXI III SHORT TERM BOND FUND RMB	30/06/2017	31/12/2016	95,47%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS GLOBAL BOND FUND	31/03/2017	30/09/2017	64.26%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS INSTICASH MONEY 3M EUR	30/11/2017	31/05/2017	3,43%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 BOND EURO CORPORATE	30/06/2017	31/12/2016	0,10%	01/01/2018	30/06/2018

BNP PARIBAS L1 BOND EUROPE PLUS	30/06/2017	31/12/2016	57,14%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 BOND WORLD EMERGING LOCAL	30/06/2017	31/12/2016	84,46%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 BOND WORLD PLUS	30/06/2017	31/12/2016	30,98%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 CONVERTIBLE BOND BEST SELECTION EUROPE	30/06/2017	31/12/2016	3,03%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 CONVERTIBLE BOND WORLD	30/06/2017	31/12/2016	2,39%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 DIVERSIFIED WORLD BALANCED	30/06/2017	31/12/2016	16,05%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 DIVERSIFIED WORLD GROWTH	30/06/2017	31/12/2016	4,95%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 MULTI-ASSET INCOME	30/06/2017	31/12/2016	8,77%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 PATRIMOINE	30/06/2017	31/12/2016	13,21%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS L1 SUSTAINABLE ACTIVE STABILITY	30/06/2017	31/12/2016	35,67%	01/01/2018	30/06/2018

BNP PARIBAS L1 USA	30/06/2017	-	0.00%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 0-5 Y EURO P	30/06/2017	31/12/2016	82,20%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 10-15 Y EURO P	30/06/2017	31/12/2016	82,90%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 15-20 Y EURO P	30/06/2017	31/12/2016	80,37%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 20-25 Y EURO P	30/06/2017	31/12/2016	94,63%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 25-35 Y EURO P	30/06/2017	31/12/2016	97,25%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 35-50 Y EURO P	30/06/2017	31/12/2016	98,06%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS LDI SOLUTION DURATION MATCHING 5-10 Y EURO P	30/06/2017	31/12/2016	80,18%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2018	28/04/2017	31/10/2017	0.39%	01/01/2018	30/06/2018

BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2021	28/04/2017	31/10/2017	6.26%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2023	28/04/2017	31/10/2017	1.73%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2026	28/04/2017	31/10/2017	1.22%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2028	28/04/2017	31/10/2017	0.00%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2033	28/04/2017	31/10/2017	0.00%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2038	28/04/2017	31/10/2017	0.00%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN EASY FUTURE 2043	28/04/2017	31/10/2017	0.00%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PLAN INTERNATIONAL DERIVATIVES	28/04/2017	31/10/2017	57.54%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PORTFOLIO FOF BALANCED	30/06/2017	31/12/2016	1,57%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PORTFOLIO FOF BALANCED SRI	30/06/2017	31/12/2016	3,10%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PORTFOLIO FOF CONSERVATIVE	30/06/2017	31/12/2016	3,59%	01/01/2018	30/06/2018

BNP PARIBAS PORTFOLIO FOF GROWTH	30/06/2017	31/12/2016	0,14%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PORTFOLIO FOF STABILITY	30/06/2017	31/12/2016	2,40%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PORTFOLIO FOF STABILITY SRI	30/06/2017	31/12/2016	4,86%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS PORTFOLIO FUND GROWTH	30/06/2017	31/12/2016	0,84%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND HIGH VOL	31/03/2017	30/09/2017	9.82%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND LOW VOL	31/03/2017	30/09/2017	15.65%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND MEDIUM VOL	31/03/2017	30/09/2017	14.30%	01/01/2018	30/06/2018
BNP PARIBAS QUAM FUND VERY HIGH VOL	31/03/2017	30/09/2017	3.69%	01/01/2018	30/06/2018
BNPP FLEXI I US MORTGAGE	31/12/2016	30/06/2017	3,63%	01/01/2018	30/06/2018
FLEXIFUND PRIVATE OPTIMISED MANAGEMENT	30/06/2017	31/12/2016	78,28%	01/01/2018	30/06/2018
FLEXIFUND SHORT TERM RMB	30/06/2017	31/12/2016	93,92%	01/01/2018	30/06/2018

PARVEST BOND ABSOLUTE RETURN V350	30/06/2017	31/12/2016	20,69%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND ABSOLUTE RETURN V700	30/06/2017	31/12/2016	24,29%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND ASIA EX-JAPAN	30/06/2017	31/12/2016	4,23%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND BEST SELECTION WORLD EMERGING	30/06/2017	31/12/2016	52,57%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND EURO	30/06/2017	31/12/2016	64,13%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND EURO GOVERNMENT	30/06/2017	31/12/2016	85,75%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND EURO INFLATION- LINKED	30/06/2017	31/12/2016	98,85%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND EURO LONG TERM	30/06/2017	31/12/2016	96,83%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND EURO MEDIUM TERM	30/06/2017	31/12/2016	51,55%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND EURO SHORT TERM	30/06/2017	31/12/2016	49,45%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND JPY	30/06/2017	31/12/2016	99,85%	01/01/2018	30/06/2018

PARVEST BOND RMB	30/06/2017	-	30,97%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND USD	30/06/2017	31/12/2016	13,20%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND USD SHORT DURATION	30/06/2017	31/12/2016	36,76%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND WORLD	30/06/2017	31/12/2016	34,43%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND WORLD EMERGING	30/06/2017	31/12/2016	42,45%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND WORLD EMERGING LOCAL	30/06/2017	31/12/2016	87,10%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST BOND WORLD INFLATION- LINKED	30/06/2017	31/12/2016	94,42%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST CONVERTIBLE BOND ASIA	30/06/2017	31/12/2016	3,86%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST CONVERTIBLE BOND EUROPE	30/06/2017	31/12/2016	6,67%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST CONVERTIBLE BOND WORLD	30/06/2017	31/12/2016	1,75%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST COVERED BOND EURO	30/06/2017	31/12/2016	5,51%	01/01/2018	30/06/2018

PARVEST CROSS ASSET ABSOLUTE RETURN	30/06/2017	31/12/2016	1,15%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST DIVERSIFIED DYNAMIC	30/06/2017	31/12/2016	4,06%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST ENHANCED CASH 6 MONTHS	30/06/2017	31/12/2016	3,55%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST FLEXIBLE BOND EURO	30/06/2017	31/12/2016	48,73%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST FLEXIBLE BOND EUROPE CORPORATE	30/06/2017	31/12/2016	0,13%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST FLEXIBLE MULTI-ASSET	30/06/2017	31/12/2016	7,83%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST MONEY MARKET EURO	30/06/2017	31/12/2016	3,66%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST MULTI-ASSET INCOME EMERGING	30/06/2017	31/12/2016	32,63%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST SUSTAINABLE BOND EURO	30/06/2017	31/12/2016	51,30%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST SUSTAINABLE BOND EURO CORPORATE	30/06/2017	31/12/2016	0,27%	01/01/2018	30/06/2018
PARVEST SUSTAINABLE BOND WORLD CORPORATE	30/06/2017	31/12/2016	0,22%	01/01/2018	30/06/2018

PARWORLD CHAMPIONS - EUROPA	31/03/2017	30/09/2017	32.70%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD CHAMPIONS - MONDO GENIUS & RELAX	31/03/2017	30/09/2017	40.58%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD CHAMPIONS - MONDO PMI	31/03/2017	30/09/2017	29.97%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD CHAMPIONS - MONDO PMI 2	31/03/2017	30/09/2017	35.29%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD FLEXIBLE CONVERTIBLE BOND	31/03/2017	30/09/2017	0.65%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD LYRA	31/03/2017	30/09/2017	2.57%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD MULTI FACTOR INVESTING	31/03/2017	30/09/2017	0.00%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD MULTI-ASSET BOOSTER	31/03/2017	30/09/2017	70.43%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD TRACK EMU GOVERNMENT BOND 1-10 Y	-	30/09/2017	99.94%	01/01/2018	30/06/2018
PARWORLD TRACKER MACRO OPPORTUNITIES	31/03/2017	30/09/2017	3.77%	01/01/2018	30/06/2018