

FICHE TRIMESTRIELLE

Février 2024

SecurAsset (LU) Switch-to-bond 09/2026

XS1356740107

Caractéristiques générales

Référence interne	SAS3476GI
Nom complet du produit	SecurAsset (LU) Switch-to-bond 09/2026
Émetteur	SecurAsset SA
Garant	BNP Paribas Fortis
Rating (*) du garant au moment de l'émission	Aa3 (stable outlook) chez Moody's, A+ (stable outlook) chez S&P, AA- (stable outlook) chez Fitch
Rating (*) actuel du garant au 1 février 2024	Aa3 (Stable outlook) chez Moody's, A+ (Stable outlook) chez S&P, AA- (Stable outlook) chez Fitch
Coupages	100 EUR
Profil d'investisseur (*) à la date d'émission	Conservateur à neutre
Profil d'investisseur (*) au 1 février 2024	Conservateur à neutre
Date d'émission	23 septembre 2016
Date d'échéance	23 septembre 2026
Sous-jacent	The Ethical Europe Climate Care Index

(1) Un rating est donné à titre purement indicatif et ne constitue pas une obligation ou une recommandation d'acheter, de vendre ou de conserver les titres.

(2) Déterminé selon les critères de BNP Paribas

Valorisation historique du produit ⁽³⁺⁴⁾

Dernière valeur du mois ⁽⁴⁾	Pourcentage du nominal
31 août 2023	94,36
29 septembre 2023	93,00
31 octobre 2023	92,76
30 novembre 2023	95,43
29 décembre 2023	96,65
31 janvier 2024	97,84

(3) Source: BNP Paribas Arbitrage S.N.C.

(4) Les données historiques ne constituent pas une indication fiable de la valeur future ou du rendement final du produit. Les valorisations indiquées ci-dessus constituent uniquement une indication de l'évolution de la valeur de marché de l'instrument de dette (le prix variant notamment en fonction de l'évolution (i) des taux d'intérêt, (ii) du risque crédit sur l'émetteur ou le garant, (iii) du sous-jacent). Des différences importantes peuvent exister entre les résultats présentés dans ce document et les résultats obtenus par un détenteur particulier, en raison de l'évolution des marchés et/ou des conditions économiques.

Mécanisme de rendement

À la fin des années 1 à 9, l'émetteur peut décider de procéder au « switch ». L'investisseur reçoit alors :

- un coupon de 5% pour chaque année écoulée jusqu'au « switch »
- un coupon annuel de 5% pour les années postérieures au « switch »
- à l'échéance, 100% du capital, en plus du dernier coupon annuel de 5%

À l'échéance, si l'émetteur n'a pas exercé son droit de « switch », le niveau de l'indice est observé à chacune des 25 dernières dates d'observation mensuelle. La moyenne est ensuite comparée à la valeur initiale de l'indice, calculée comme la moyenne des 7 premières dates d'observation mensuelle, ce qui permet d'obtenir la performance moyenne.

Si cette performance moyenne est :

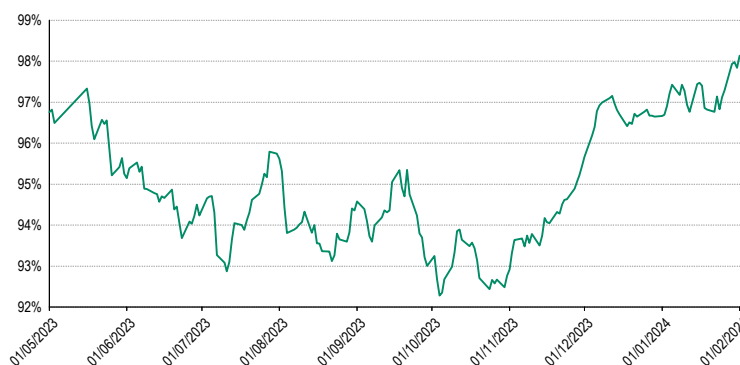
- négative : aucun coupon n'est versé et l'investisseur récupère 100% du capital
- positive : un coupon d'un montant égal à la performance moyenne de l'indice est versé, en plus du remboursement à 100% du capital investi.

Ces documents sont disponibles gratuitement aux guichets de toute agence BNP Paribas Fortis ainsi que sur le site www.bnpparibasfortis.be/emissions

En cas de discordance entre la présente fiche et les Final Terms, les Final Terms prévalent.

Valeur historique depuis la date d'émission ⁽³⁺⁴⁾

Ces valorisations ne sont qu'indicatives et sont exprimées en MID, c'est-à-dire la moyenne entre le prix offert et le prix demandé.



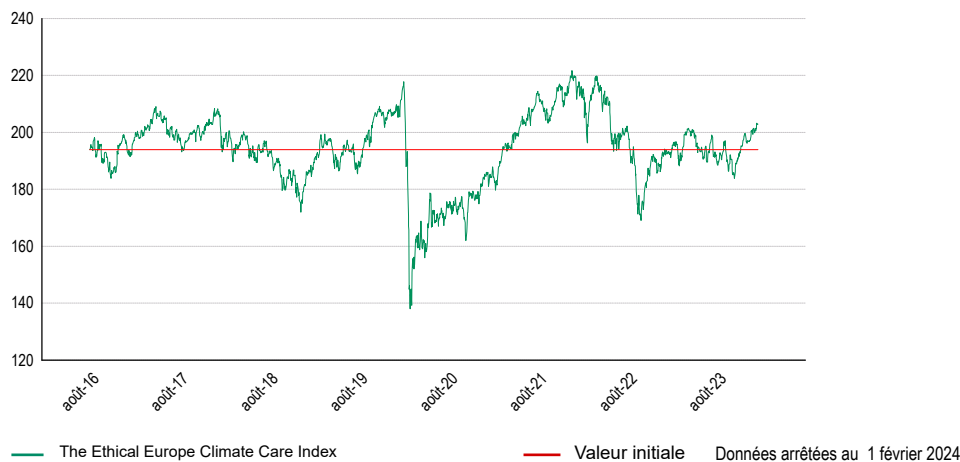
Données arrêtées au 1 février 2024

Suivi de performance du sous-jacent ⁽⁵⁾

Nom du sous-jacent	Valeur initiale (au 23/09/2016)	Valeur au 31/01/2024	Performance réelle au 31/01/2024
Ethical Europe Climate Care Index	193,92	202,78	4,57%

(5) Source: Bloomberg.

Valeur historique de l'indice The Ethical Europe Climate Care Index depuis la date de strike (19/08/2016) ⁽⁵⁾



Disclaimer

BNP Paribas Fortis SA est responsable de la production de ce document destiné à être distribué uniquement aux détenteurs du produit visé par ledit document, détenu en comptétites chez BNP Paribas Fortis SA et ayant acheté ces produits par l'intermédiaire de BNP Paribas Fortis SA (ci-après le "Détenteur"). Ce document ne constitue pas une communication à caractère promotionnel ni une brochure à caractère promotionnel mais un document à caractère informatif destiné à être distribué aux Détenteurs pour suivre l'évolution du produit.

Ce document ne constitue pas 1) une offre d'achat ou de vente ou une sollicitation à la vente, à l'achat ou à la souscription des produits ou des instruments financiers visés dans ce document ou 2) un conseil en investissement et ne peut être utilisé à d'autres fins que celles pour lesquelles il a été rédigé. En raison de l'évolution des marchés et/ou des conditions économiques, des différences importantes peuvent exister entre les résultats présentés dans ce document et les résultats réels finaux obtenus par un Détenteur particulier.

Toutes les informations reçues de sources externes proviennent de sources fiables et sûres mais la précision ainsi que le caractère complet de ces informations ne peut être garanti par BNP Paribas Fortis SA. Les performances ou réalisations passées ne présument en aucun cas des résultats futurs.

La distribution de ce document ainsi que l'offre ou la vente de produits visés par ce document ne peuvent avoir lieu dans les juridictions où la distribution de ce document, l'offre ou la vente de ces produits serait contraire à la législation ou la réglementation locale. Ni l'Émetteur ni BNP Paribas Fortis SA ne garantissent que ce document puisse être légalement distribué, ou que tout produit puisse être légalement offert, conformément aux exigences d'enregistrement applicables ou à tout autre exigence d'une quelconque juridiction ou conformément à toute exemption applicable, et n'assument aucune responsabilité concernant la facilitation de cette distribution ou de cette offre. En particulier, l'Émetteur et BNP Paribas Fortis SA n'ont entrepris aucune action particulière en vue de soumettre le présent document aux autorités compétentes d'une quelconque juridiction. Il est recommandé aux personnes en possession de ce document ou de produits visés par ce document de s'informer et de respecter toute restriction concernant (i) la distribution de ce document et (ii) l'offre et/ou la vente de ces produits.

Le présent document est publié en exécution du Moratoire de la FSMA sur la commercialisation des produits structurés particulièrement complexes (le "Moratoire").

Plus d'infos sur le Moratoire: http://www.fsma.be/fr/Article/nipic/nipic_tsspersonen.aspx

BNP Paribas Fortis SA ne pourra être tenu pour responsable de toute utilisation de ce document en dehors du contexte de ce Moratoire et des dommages directs ou indirects qui pourraient résulter d'un tel usage.