

FICHE TRIMESTRIELLE

Janvier 2025

BNP Paribas Fortis Funding (LU) - Capped Note Lookback Deep Value Europe 2027

XS1959893543

Caractéristiques générales

Référence interne	EM2100FLD
Nom complet du produit	BNP Paribas Fortis Funding (LU) Capped Note Lookback Deep Value Europe 2027
Émetteur	BNP Paribas Fortis Funding
Garant	BNP Paribas Fortis SA
Rating (1) du garant au moment de l'émission	A2 (stable outlook) chez Moody's, A (positive outlook) chez S&P, A+ (stable outlook) chez Fitch
Rating (1) actuel du garant au 1 janvier 2025	A2 (Stable outlook) chez Moody's, A+ (Stable Outlook) chez S&P, AA- (Stable outlook) chez Fitch
Coupages	1 000,00 EUR
Profil d'investisseur (2) à la date d'émission	Défensif à dynamique
Profil d'investisseur (2) au 1 janvier 2025	Défensif à dynamique
Date d'émission	10 mai 2019
Date d'échéance	10 mai 2027
Sous-jacent	Dynamic Deep Value Equity Europe (ENHADEEP 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 Fortis.

Valorisation historique du produit (3+4)

Dernière valeur du mois (4)	Pourcentage du nominal
31 juillet 2024	109,49
30 août 2024	110,74
30 septembre 2024	113,13
31 octobre 2024	112,07
29 novembre 2024	112,64
31 décembre 2024	110,72

(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 et/ou le garant, (iii) du sous-jacent). Des différences importantes peuvent exister entre les résultats présentés dans ce document et les résultats réels obtenus par un détenteur particulier, en raison de l'évolution des marchés et/ou des conditions économiques.

(5) Ce pourcentage ne préjuge en rien du rendement final et tient compte de la commission de placement de 2%.

Mécanisme de rendement

Le 10 mai 2027, la BP2F Capped Note Lookback Deep Value Europe 2027 donnera droit :

- au remboursement à 100% de la valeur nominale.
- à une prime de remboursement égale à 100% de l'évolution positive éventuellement enregistrée par l'indice Dynamic Deep Value Equity Europe (Price) entre sa valeur initiale, optimisée grâce au système de Lookback, et sa valeur finale.

La hausse de l'indice prise en considération sera plafonnée à 50% maximum, ce qui correspond à un rendement actuariel brut maximal de 4.94%.

Si l'indice enregistre une performance nulle ou négative, aucune prime de remboursement ne sera versée.

Effet Lookback: la valeur initiale de l'indice, servant de base au calcul de la prime de remboursement éventuelle, correspondra au cours de clôture le plus bas de l'indice parmi quatre observations mensuellement réparties sur les trois premiers mois de l'investissement.

Droit au remboursement à 100 % de la valeur nominale du capital (1 000 euros par coupure) à l'échéance finale, sauf en cas de faillite ou de défaut de paiement de l'émetteur et du garant.

Pour plus d'informations sur la structure du produit et sur les risques liés à ce produit, veuillez lire le Flash Invest et la documentation utilisée pour le marché primaire.

Documentation utilisée pour le marché primaire: Le prospectus de base daté du 05/06/2018 et ses suppléments datés du 09/08/2018, du 25/09/2018, du 22/11/2018 et du 31/12/2018 tous approuvés par la Commission de surveillance du secteur Financier (Cssf) au Luxembourg, ainsi que les Final Terms datées du 29/03/2019, sont rédigés en anglais et constituent ensemble le Prospectus. Un résumé du prospectus est également disponible en français. 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 janvier 2025

Suivi de performance du sous-jacent ⁽⁵⁾

Nom du sous-jacent	Période	dates d'observation	Cours de clôture
Dynamic Deep Value Equity Europe Index	1	02/05/2019	232,38
	2	03/06/2019	220,31
	3	02/07/2019	228,44
	4	02/08/2019	217,20
Valeur au 31/12/2024			257,56
Valeur initiale*			217,20

(5) Source: Bloomberg.

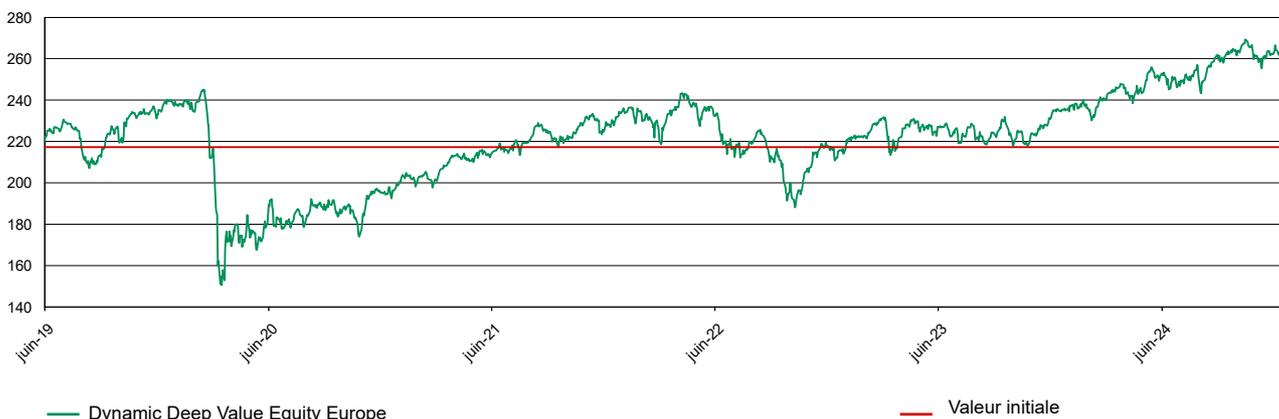
*Le cours de clôture le plus bas parmi quatre dates d'observations initiales (2 Mai 2019, 3 Juin 2019, 2 Juillet 2019 et 2 août 2019)

Nom du sous-jacent	Valeur initiale (au 02/08/2019)*	Valeur au 31/12/2024	Performance réelle au 31/12/2024
Dynamic Deep Value Equity Europe Index	217,20	257,56	18,58%

(5) Source: Bloomberg.

* niveau le plus bas pour le moment.

Valeur historique de l'indice depuis la date de strike



— Dynamic Deep Value Equity Europe

— Valeur initiale

Données arrêtées au 1 janvier 2025

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 compte-titres 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.