BNP PARIBAS FORTIS
PRIVATE BANKING

FICHE TRIMESTRIELLE

Octobre 2023

BNP PARIBAS FORTIS FUNDING (LU) Callable Deep Value World Ex-Dis Note 2030 – N209

XS2176806466

Caractéristiques générales

Référence interne	EM0059JVH
Nom complet du produit	BNP PARIBAS FORTIS FUNDING (LU) Callable Deep Value World Ex-Dis Note 2030 – N209
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+ (negative outlook) chez S&P, A+ (credit watch negative) chez Fitch
Rating (¹) actuel du garant au 2 octobre 2023	A2 (Stable outlook) chez Moody's, A+ (Stable Outlook) chez S&P, AA- (Stable outlook) chez Fitch
Coupures	1 000,00 EUR
Date d'émission	12 août 2020
Date d'échéance	12 août 2030
Sous-jacent	SOLACTIVE DEEP VALUE WORLD MV EX-DA (PR) (SOWDEEXP 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 Private Banking.

Mécanisme de rendement

D'une durée maximale de 10 ans, ce produit structuré associe son rendement final à l'évolution de l'indice Solactive Deep value World MV Ex DA price index. À partir de la troisième année, l'émetteur se réserve toutefois le droit de procéder à un remboursement anticipé à 100% de la valeur nominale. En cas de remboursement anticipé et uniquement dans ce cas, l'investisseur aura droit à un coupon, dont le montant brut sera égal à 4% multiplié par le nombre d'années écoulées depuis la date d'émission. À l'échéance finale, en l'absence de remboursement anticipé et en cas de recul de l'indice, l'investisseur recevra 100% de la valeur nominale. En cas de stabilité ou de progression de l'indice, l'investisseur recevra 100% de la valeur nominale ainsi qu'une prime de remboursement égale à 100% de la performance positive de l'indice. La performance finale équivaut à l'évolution observée entre le niveau initial relevé le 03 août 2020 et le niveau final. Ce dernier correspond à la moyenne arithmétique des valeurs de l'indice relevées aux 19 dates prédéterminées, mensuellement réparties entre le 29 janvier 2029 et le 29 juillet 2030.

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 02/06/2020, approuvés par la Commission de surveillance du secteur Financier (CssF) au Luxembourg, ainsi que les Final Terms du 18/06/2020, 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.

Valorisation historique du produit (3+4)

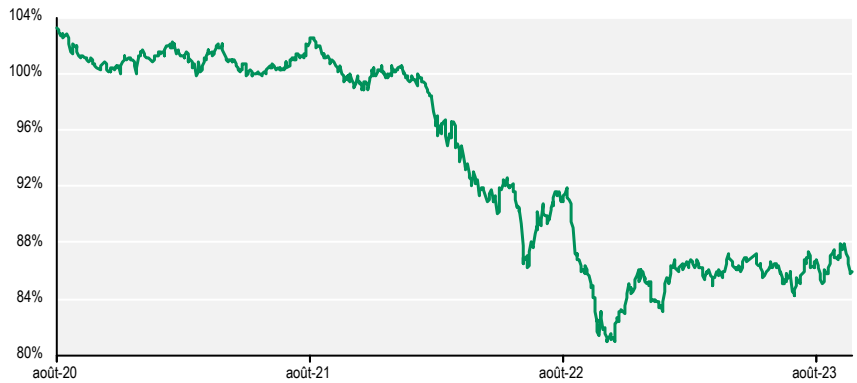
Valorisation début du mois	Pourcentage du nominal
3 avril 2023	86,49
1 mai 2023	86,91
1 juin 2023	85,93
3 juillet 2023	85,58
1 août 2023	87,36
1 septembre 2023	87,10
2 octobre 2023	86,01

(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.

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.



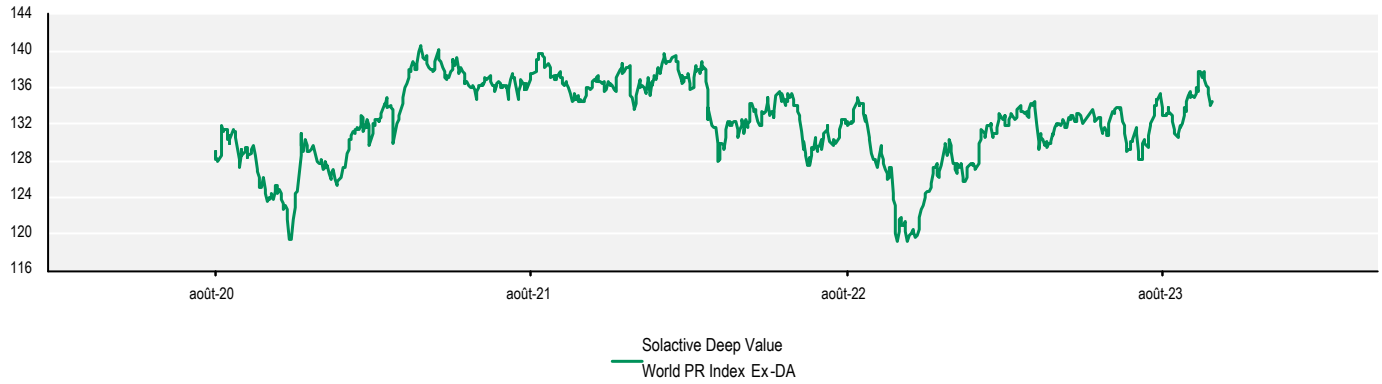
Données arrêtées au 2 octobre 2023

Suivi de performance du sous-jacent [5]

Nom du sous-jacent	Valeur initiale (au 03/08/2020)	Valeur au 29/09/2023	Performance réelle au 29/09/2023
Solactive Deep Value World PR Index Ex-DA	128,16	134,57	5,00%

(5) Source: Bloomberg.

Valeur historique du sous-jacent depuis la date de strike (03/08/2020)



Données arrêtées au 2 octobre 2023

Définition valeur acquise du sous-jacent [5]

Dates d'observation	SOLACTIVE DEEP VALUE WORLD MV EX-DA (PR) (SOWDEEXP Index)
29 janvier 2029	-
28 février 2029	-
29 mars 2029	-
30 avril 2029	-
29 mai 2029	-
29 juin 2029	-
30 juillet 2029	-
29 août 2029	-
1 octobre 2029	-
29 octobre 2029	-
29 novembre 2029	-
2 janvier 2030	-
29 janvier 2030	-
28 février 2030	-
29 mars 2030	-
29 avril 2030	-
29 mai 2030	-
1 juillet 2030	-
29 juillet 2030	-

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.
Sauf accord écrit avec BNP Paribas, le prix de tout panier, portefeuille, stratégie ou tout autre sous-jacent (la « Valeur de l'Actif ») vous est fourni en complément d'une Valorisation à la condition que vous ne diffusiez pas cette Valeur d'Actif, ni ne preniez aucune mesure susceptible d'être considérée comme « une publication ou une mise à disposition du public » de cette Valeur d'Actif au sens du règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du Conseil du 8 juin 2016 concernant les indices utilisés comme indices de référence dans le cadre d'instruments et contrats financiers ou pour mesurer la performance des fonds d'investissement et modifiant les directives 200/8/48/CE et 2014/17/UE et le règlement (UE) no 596/2014 (le « règlement sur les indices de référence »).

10. 2023 - E.R.: I. Van Aelst - BNP Paribas Fortis SA, Montagne du Parc 3, B-1000 Bruxelles - RPM Bruxelles - TVA BE 0403.199.702