



## DRIEMAANDELIJKE FICHE

Juli 2022

### BNP PARIBAS FORTIS FUNDING (LU) Callable Deep Value World Note 2031 – N219

XS2241136683

#### Algemene kenmerken

<b>Interne referentie</b>	EM0088JVH
<b>Volledige naam van het product</b>	BNP PARIBAS FORTIS FUNDING (LU) Callable Deep Value World Note 2031 – N219
<b>Emitent</b>	BNP Paribas Fortis Funding
<b>Garant</b>	BNP Paribas Fortis NV
<b>Rating (*) van de garant op het moment van de uitgifte</b>	A2 (stable outlook) bij Moody's, A+ (negative outlook) bij S&P, A+ (rating watch negative) bij Fitch
<b>Huidige rating (*) van de garant op 1 juli 2022</b>	A2 (Stable outlook) chez Moody's, A+ (Stable Outlook) chez S&P, AA- (Stable outlook) chez Fitch
<b>Coupures</b>	1.000,00 EUR
<b>Uitgiftedatum</b>	11 januari 2021
<b>Eindvervaldag</b>	13 januari 2031
<b>Onderliggend</b>	SOLACTIVE DEEP VALUE WORLD MV EX-DA (PR) (SOWDEEXP Index)

(1) Een rating wordt louter indicatief meegedeeld en vormt geen verplichting of aanbeveling tot kopen, meekopen of bewaren van de effecten.

(2) Bepaald volgens de criteria van BNP Paribas Fortis Private Banking.

#### Historische waardering van het product<sup>(3+4)</sup>

Waardering begin van de maand	Percentage van de nominale waarde
3 januari 2022	96,11
1 februari 2022	94,91
1 maart 2022	92,00
1 april 2022	88,83
2 mei 2022	87,11
1 juni 2022	87,50
1 juli 2022	84,60

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

(4) De historische gegevens vormen geen betrouwbare aanwijzing van de toekomstige waarde of het eindrendement van het product. De waarderingen hierboven vormen enkel een aanwijzing van de evolutie van (i) de rentevoeten, (ii) het kredietrisico van de emitent en/of de garant, (iii) het onderliggende. Belangrijke verschillen kunnen bestaan tussen resultaten die voorgesteld worden in dit document en de reële resultaten die behaald werden door een particuliere bezitter, wegens de marktvoluitie en/of de economische omstandigheden.

#### Rendementsmechanisme

Deze gestructureerde obligatie heeft een looptijd van maximaal 10 jaar en koppelt het rendement op vervaldag aan de evolutie van de Solactive Deep Value World MV ex DA price index. Vanaf het derde jaar behoudt de emitent zich het recht voor om over te gaan tot een vervroegde terugbetaling tegen 100% van de nominale waarde. Bij een vervroegde terugbetaling heeft de belegger recht op een terugbetalingspremie gelijk aan 3% vermenigvuldigd met het aantal jaren dat sinds de uitgiftedatum verstreken is. Indien er geen vervroegde terugbetaling gebeurt en ingeval van een daling van de index, ontvangt de belegger op eindvervaldag 100% van zijn nominale. In geval van een stabiele of stijgende index, zal de belegger 100% van de nominale waarde ontvangen, plus een mogelijke terugbetalingspremie, gelijk aan 100% van de eindprestatie van de index. De eindprestatie van de index is gelijk aan de evolutie die is waargenomen tussen het initiële niveau dat op 04 januari 2021 werd vastgelegd en het finale niveau. Dit laatste komt overeen met het rekenkundig gemiddelde van de indexwaarden die zijn geregistreerd op 19 vooraf bepaalde datums, maandelijks vastgelegd tussen 2 juli 2029 en 29 december 2030.

Voor meer informatie over de structuur van het product, gelieve de Flash Invest te raadplegen, evenals de documentatie die gebruikt wordt voor de primaire markt.

Documentatie gebruikt voor de primaire markt: het basisprospectus van 02/06/2020 en zijn supplement van 06/07/2020, van 17/08/2020 et van 25/09/2020, allebei goedgekeurd door de Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF) in Luxemburg, zijn evenals de Final Terms van 30/10/2020 opgesteld in het Engels en vormen samen het Prospectus. Een samenvatting van het basisprospectus in het Nederlands is eveneens beschikbaar. Een samenvatting van het basisprospectus in het Nederlands is eveneens beschikbaar. Deze documenten zijn gratis beschikbaar aan de loketten van elk kantoor van BNP Paribas Fortis en op de site [www.bnpparibasfortis.be/emissies](http://www.bnpparibasfortis.be/emissies). Bij tegenstrijdigheid tussen dit document en de Final Terms, primeren de Final Terms.

#### Historische waarde sinds de uitgiftedatum<sup>(3+4)</sup>

Deze waarderingen zijn enkel indicatief en uitgedrukt in MID, d.w.z. het gemiddelde tussen de biedprijs en de laatprijs.



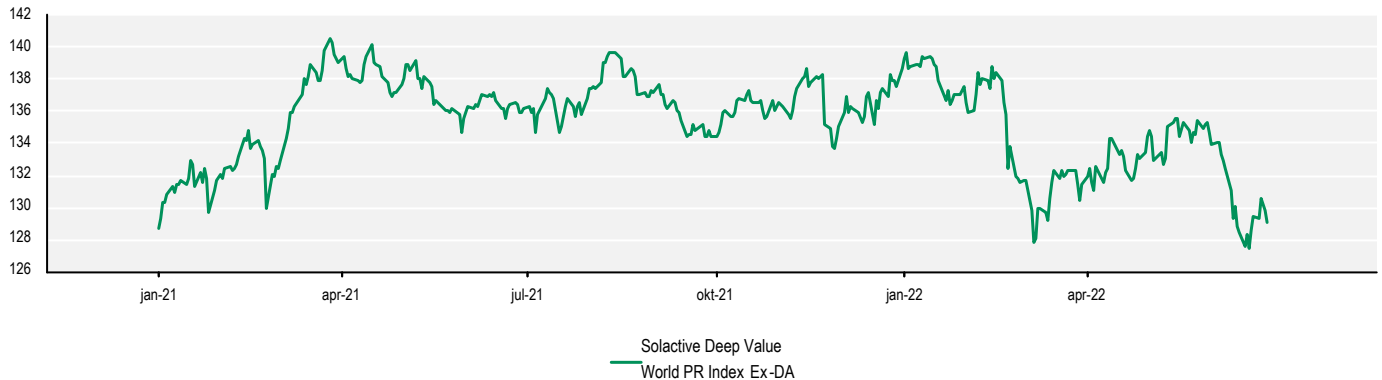
Gegevens bepaald op 1 juli 2022

## Opgvolging van de prestatie van het onderliggende <sup>(5)</sup>

Naam van het onderliggende	Initiële waarde (op 04/01/2021)	Waarde op 30/06/2022	Reële prestatie op 30/06/2022
Solactive Deep Value World PR Index Ex-DA	128,72	129,07	0,27%

(5) Bron: Bloomberg.

## Historische waarde van de onderliggende waarde sinds de stakingsdatum (04/01/2021)



Gegevens bepaald op 1 juli 2022

## Bepaling eindwaarde de onderliggende waard<sup>(5)</sup>

Observatiedatum	SOLACTIVE DEEP VALUE WORLD MV EX-DA (PR) (SOWDEEXP Index)
2 juli 2029	-
30 juli 2029	-
30 augustus 2029	-
1 oktober 2029	-
30 oktober 2029	-
30 november 2029	-
2 januari 2030	-
30 januari 2030	-
28 februari 2030	-
1 april 2030	-
30 april 2030	-
30 mei 2030	-
1 juli 2030	-
30 juli 2030	-
30 augustus 2030	-
30 september 2030	-
30 oktober 2030	-
2 december 2030	-
30 december 2030	-

### Disclaimer

BNP Paribas Fortis NV is verantwoordelijk voor het opstellen van dit document dat uitsluitend bestemd is voor de houders van de hierin beschreven financiële instrumenten, die worden aangehouden op effectenrekeningen van BNP Paribas Fortis NV en die werden verkregen door bemiddeling van BNP Paribas Fortis NV (hierna de "Houder"). Dit document bevat géén reclame en is géén marketing brochure maar is een informatief document bestemd voor de Houders om ze op de hoogte te houden van de evolutie van de financiële instrumenten.

Dit document is geen 1) aankoop- of verkoopbod of een vraag tot verkoop, aankoop of de intekening op de financiële instrumenten beschreven in dit document, of 2) een investeringsadvies. Het document mag enkel gebruikt worden voor de doeleinden waarvoor het werd opgesteld.

Ingevolge de marktvoluitie en/of de economische omstandigheden kunnen er belangrijke verschillen bestaan tussen de resultaten weergegeven in dit document en de uiteindelijke resultaten die door een individuele Houder worden behaald.

Alle informatie die buitenshuis verkregen werd komt van betrouwbare bronnen maar de nauwkeurigheid en het complete karakter van deze informatie kan niet gegarandeerd worden door BNP Paribas Fortis NV. Prestaties uit het verleden zijn in geen geval een garantie voor toekomstige resultaten.

De verdeling van dit document, net als het aanbod of de verkoop van de financiële instrumenten beschreven in dit document kan enkel gebeuren in de rechtsgebieden waar de verdeling van dit document, het aanbod of de verkoop van deze producten niet strijdig is met de plaatselijke wetgeving en regels. Noch de Emittent, noch BNP Paribas Fortis NV garanderen dat dit document wettelijk mag verdeeld worden of dat de effecten wettelijk mogen worden aangeboden, overeenkomstig de toepasselijke registratieverplichtingen

van om het even welke jurisdictie of de toepasselijke vrijstellingen en neemt geen aansprakelijkheid op zich voor de mogelijkheid tot deze verspreiding of enig aanbod. Meer in het bijzonder, de Emittent en BNP Paribas Fortis NV hebben geen enkele specifieke actie ondernomen om het onderhavig document voor te leggen aan de bevoegde autoriteiten van om het even welke jurisdictie. Houders van dit document of van de financiële instrumenten beschreven in dit document wordt aangeraden om zich te informeren en elke

beperking te respecteren met betrekking tot (i) de verspreiding van dit document en (ii) het aanbod en/of de verkoop van deze financiële instrumenten.

Huidig document wordt gepubliceerd in uitvoering van het moratorium van het FSMA op de commercialisering van bijzonder ingewikkelde gestructureerde producten (het "moratorium").

Meer informatie over het moratorium: [http://www.fsma.be/nl/article/nipic/nipic\\_tsspersionen.aspx](http://www.fsma.be/nl/article/nipic/nipic_tsspersionen.aspx)

BNP Paribas Fortis NV kan niet aansprakelijk gehouden worden voor om het even welk gebruik van dit document en voor alle rechtstreekse of onrechtstreekse schade die wordt opgelopen door gebruik van dit document buiten de context van het Moratorium.

Tenzij anderszins met BNP Paribas schriftelijk overeengekomen wordt de prijs van enige beleggingsmand, portfolio, strategie of andere basiswaarde (de 'activawaarde'), die in aanvulling op een Waardebepaling aan u wordt meegedeeld, verstrekt onder de voorwaarde dat u die activawaarde niet verspreidt en ook niets ondernemeet, dat ertoe zou kunnen leiden dat de activawaarde beschouwd wordt als 'gepubliceerd of beschikbaar gemaakt voor het publiek' in de zin van Verordening (EU) 2016/1011 van het Europees Parlement en de Raad van 8 juni 2016 betreffende indices, die worden gebruikt als benchmarks voor financiële instrumenten en financiële overeenkomsten dan wel om de prestatie van beleggingsfondsen te meten en tot wijziging van Richtlijnen 2008/48/EG en 2014/17/EU en Verordening (EU) nr. 596/2014 (de 'Benchmarkverordening').