

BNP PARIBAS FUNDS SICAV



RAPPORT ANNUEL au 31/12/2023
R.C.S. Luxembourg B 33 363



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

L'investisseur
durable d'un
monde qui change

Table des matières

| | Page |
|--|------|
| Organisation | 4 |
| Renseignements | 6 |
| Rapport de gestion | 7 |
| Rapport d'audit | 13 |
| Etats financiers au 31/12/2023 | 16 |
| Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices | 37 |
| Portefeuille-titres au 31/12/2023 | |
| <i>Aqua</i> | 71 |
| <i>Asia High Yield Bond</i> | 72 |
| <i>Asia Tech Innovators</i> | 75 |
| <i>Belgium Equity</i> | 76 |
| <i>Brazil Equity</i> | 77 |
| <i>China A-Shares</i> | 78 |
| <i>China Equity</i> | 79 |
| <i>Climate Impact</i> | 80 |
| <i>Consumer Innovators</i> | 81 |
| <i>Disruptive Technology</i> | 82 |
| <i>Ecosystem Restoration</i> | 83 |
| <i>Emerging Bond</i> | 84 |
| <i>Emerging Bond Opportunities</i> | 89 |
| <i>Emerging Equity</i> | 94 |
| <i>Emerging Markets Climate Solutions</i> | 95 |
| <i>Energy Transition</i> | 96 |
| <i>Enhanced Bond 6M</i> | 97 |
| <i>Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH)</i> | 100 |
| <i>Euro Bond</i> | 101 |
| <i>Euro Bond Opportunities</i> | 104 |
| <i>Euro Corporate Bond</i> | 109 |
| <i>Euro Corporate Bond Opportunities</i> | 113 |
| <i>Euro Corporate Green Bond</i> | 117 |
| <i>Euro Defensive Equity</i> | 120 |
| <i>Euro Equity</i> | 121 |
| <i>Euro Flexible Bond</i> | 122 |
| <i>Euro Government Bond</i> | 124 |
| <i>Euro High Yield Bond</i> | 126 |
| <i>Euro High Yield Short Duration Bond</i> | 128 |
| <i>Euro Inflation-Linked Bond</i> | 131 |
| <i>Euro Medium Term Bond</i> | 132 |

Table des matières

| | Page |
|---|------|
| <i>Euro Money Market</i> | 135 |
| <i>Euro Short Term Corporate Bond Opportunities</i> | 137 |
| <i>Europe Convertible</i> | 142 |
| <i>Europe Equity</i> | 144 |
| <i>Europe Growth</i> | 145 |
| <i>Europe High Conviction Bond</i> | 146 |
| <i>Europe Real Estate Securities</i> | 148 |
| <i>Europe Small Cap</i> | 149 |
| <i>Europe Small Cap Convertible</i> | 150 |
| <i>Flexible Global Credit</i> | 151 |
| <i>Global Absolute Return Multi-Factor Bond</i> | 152 |
| <i>Global Bond Opportunities</i> | 153 |
| <i>Global Climate Solutions</i> | 161 |
| <i>Global Convertible</i> | 162 |
| <i>Global Enhanced Bond 36M</i> | 164 |
| <i>Global Environment</i> | 167 |
| <i>Global High Yield Bond</i> | 168 |
| <i>Global Inflation-Linked Bond</i> | 172 |
| <i>Green Bond</i> | 174 |
| <i>Green Tigers</i> | 178 |
| <i>Health Care Innovators</i> | 179 |
| <i>Inclusive Growth</i> | 180 |
| <i>India Equity</i> | 181 |
| <i>Japan Equity</i> | 182 |
| <i>Japan Small Cap</i> | 183 |
| <i>Latin America Equity</i> | 185 |
| <i>Local Emerging Bond</i> | 186 |
| <i>Multi-Asset Opportunities</i> | 188 |
| <i>Multi-Asset Thematic</i> | 190 |
| <i>Nordic Small Cap</i> | 191 |
| <i>RMB Bond</i> | 192 |
| <i>Russia Equity (VNI suspendue)</i> | 193 |
| <i>Seasons</i> | 194 |
| <i>SMaRT Food</i> | 195 |
| <i>Social Bond</i> | 196 |
| <i>Sustainable Asia ex-Japan Equity</i> | 198 |
| <i>Sustainable Asian Cities Bond</i> | 199 |
| <i>Sustainable Enhanced Bond 12M</i> | 200 |

Table des matières

| | Page |
|--|------|
| <i>Sustainable Euro Bond</i> | 203 |
| <i>Sustainable Euro Corporate Bond</i> | 206 |
| <i>Sustainable Euro Low Vol Equity</i> | 212 |
| <i>Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond</i> | 213 |
| <i>Sustainable Euro Multi-Factor Equity</i> | 215 |
| <i>Sustainable Europe Dividend</i> | 216 |
| <i>Sustainable Europe Multi-Factor Equity</i> | 217 |
| <i>Sustainable Europe Value</i> | 219 |
| <i>Sustainable Global Corporate Bond</i> | 220 |
| <i>Sustainable Global Equity</i> | 229 |
| <i>Sustainable Global Low Vol Equity</i> | 230 |
| <i>Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond</i> | 232 |
| <i>Sustainable Global Multi-Factor Equity</i> | 235 |
| <i>Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond</i> | 237 |
| <i>Sustainable Japan Multi-Factor Equity</i> | 239 |
| <i>Sustainable Multi-Asset Balanced</i> | 240 |
| <i>Sustainable Multi-Asset Flexible</i> | 245 |
| <i>Sustainable Multi-Asset Growth</i> | 246 |
| <i>Sustainable Multi-Asset Stability</i> | 247 |
| <i>Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond</i> | 251 |
| <i>Sustainable US Multi-Factor Equity</i> | 253 |
| <i>Sustainable US Value Multi-Factor Equity</i> | 254 |
| <i>Target Risk Balanced</i> | 255 |
| <i>Turkey Equity</i> | 256 |
| <i>US Growth</i> | 257 |
| <i>US High Yield Bond</i> | 258 |
| <i>US Mid Cap</i> | 260 |
| <i>US Small Cap</i> | 261 |
| <i>USD Money Market</i> | 262 |
| <i>USD Short Duration Bond</i> | 263 |
| Notes aux états financiers | 264 |
| Annexe non audité | 367 |

Aucune souscription ne peut être effectuée sur la seule base des états financiers. Les souscriptions ne sont valables que si elles sont effectuées après réception du prospectus en vigueur accompagné du dernier rapport annuel et du rapport semi-annuel le plus récent, si celui-ci est postérieur au rapport annuel.

Organisation

Siège social

10 Rue Edward Steichen, L-2540 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Conseil d'Administration

Président

M. Pierre MOULIN, « Global Head of Products and Strategic Marketing », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Paris

Membres

M. Marnix ARICKX, « Chief Executive Officer », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Succursale de Belgique, Bruxelles

Mme Giorgia D'ANNA, « Head of Group Networks Italy and International », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Paris

Mme Cécile du MERLE, « Head of Global Product Engineering », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Paris

M. Emmanuel COLLINET DE LA SALLE, « Head of Group Networks », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Paris

Mme Marianne HUVE-ALLARD, « Head of Brand and Communication », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Paris

M. Philippe DITISHEIM, « Director », Paris, France

Mme Georgina WILTON, « Head of Business Management, Fundamental Active Equities », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd, Londres (depuis le 24 mars 2023)

M. François ROUX, « Head of Global Product Strategy », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Paris

Secrétaire de la Société (n'est pas membre du Conseil d'Administration)

M. Stephane BRUNET, « Chief Executive Officer », BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg, Luxembourg

Société de Gestion

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg, 10 Rue Edward Steichen, L-2540 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Luxembourg est une Société de Gestion au sens du chapitre 15 de la Loi luxembourgeoise du 17 décembre 2010 concernant les organismes de placement collectif, telle que modifiée.

La Société de Gestion exerce les fonctions d'administration, de gestion de portefeuille et de commercialisation.

La gestion de portefeuille est déléguée aux entités suivantes :

Gestionnaire financier effectif

Entités de gestion du Groupe BNP Paribas (généralement dénommées BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT)

- Alfred Berg Kapitalförvaltning AS, Munkedamsveien 34, PO box 1294 Vika, 0250 Oslo, Norvège, agissant également par le biais de sa succursale de Suède, Holvslagargatan 3, PO box 70447, 107 25 Stockholm, Suède
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Asia Ltd., 17/F, Lincoln House, Taikoo Place, 979 King's Road, Quarry Bay, Hong Kong
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Brasil Ltda, Av. Juscelino Kubitschek 510-11 Andar, 04543-00 São Paulo - SP, Brésil
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, 1 boulevard Haussmann, F-75009 Paris, France, agissant également par le biais de sa succursale néerlandaise, Herengracht 595, PO box 71770, NL-1008 DG Amsterdam, Pays-Bas, agissant également par le biais de sa succursale belge, Montagne du Parc 3, 1000 Bruxelles, Belgique
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Singapore Limited, 20 Collyer Quay Tung Center #01-01, Singapour 049319
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Ltd., 5 Aldermanbury Square, Londres EC2V 7BP, Royaume-Uni
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA, Inc., 200 Park Avenue, 11th floor, New York, NY 10166, Etats-Unis d'Amérique
- TEB Portföy Yönetimi A.Ş., Gayrettepe Mahallesi Yener Sokak n° 1 Kat. 9 Besiktas 34353 Istanbul, Turquie

Organisation

Entités de gestion n'appartenant pas au Groupe :

- Impax Asset Management Limited, 7th Floor, 30 Panton Street, Londres, SW1Y 4AJ, Royaume-Uni, Gestionnaire des compartiments « Aqua », « Climate Impact », « Global Environment », « Green Tigers » et « SMaRT Food »
- Mitsubishi UFJ Kokusai Asset Management Co. Ltd, 1-12-1 Yurakucho, Chiyoda-ku, Tokyo 100-0006, Japon, Gestionnaire du compartiment « Japan Equity »
- Sumitomo Mitsui DS Asset Management Company. Limited., Atago Green Hills, Mori Tower, 28F, 2-5-1 Atago Minato-ku, Tokyo 105-6228, Japon, Gestionnaire du compartiment « Japan Small Cap »

Calcul de la VNI, Agent de registre et de transfert

BNP Paribas, Succursale de Luxembourg, 60 Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Dépositaire

BNP Paribas, Succursale de Luxembourg, 60 Avenue J.F. Kennedy, L-1855 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Garant

BNP PARIBAS, 16 Boulevard des Italiens, F-75009 Paris, France

Le compartiment « Seasons » bénéficie d'une garantie. De plus amples détails figurent à la section « Informations ».

Réviseur d'entreprises

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative, 2 Rue Gerhard Mercator, B.P. 1443, L-1014 Luxembourg, Grand-Duché de Luxembourg

Renseignements

Constitution

BNP Paribas Funds (le « Fonds », la « Société ») est une société d'investissement à capital variable (SICAV sous sa forme abrégée) de droit luxembourgeois, constituée le 27 mars 1990 pour une durée indéterminée sous la dénomination « PARVEST ». La dénomination actuelle « BNP Paribas Funds » est effective à compter du 30 août 2019.

La Société est actuellement régie par les dispositions de la Partie I de la Loi du 17 décembre 2010 concernant les organismes de placement collectif, ainsi que par la Directive 2009/65, modifiée par la Directive 2014/91, et les dispositions du Règlement 2017/1131.

Le capital de la Société est exprimé en euros (« EUR ») et correspond à tout moment à la somme des actifs nets des différents compartiments. Elle est représentée par des actions entièrement libérées sans valeur nominale, décrites ci-après à la section « Actions ». Les variations de capital sont automatiques, sans les mesures de notification et d'enregistrement requises pour les augmentations et les diminutions de capital des sociétés anonymes. Son capital minimum est déterminé par la Loi.

La Société est inscrite au Registre du Commerce et des Sociétés de Luxembourg sous le n° B 33 363.

Informations à l'attention des Actionnaires

Valeurs nettes d'inventaire et dividendes

Les valeurs nettes d'inventaire sont calculées chaque jour ouvré bancaire complet à Luxembourg, à l'exception de certains compartiments. De plus amples informations sont disponibles dans le Prospectus.

Une garantie (la « Garantie ») est constituée en faveur du compartiment « Seasons » par BNP Paribas agissant en qualité de garant (le « Garant »), en vertu de laquelle ce Garant s'engage, chaque trimestre, à ce que la VNI d'une classe d'actions soit au moins égale à 80% de la VNI de cette même classe d'actions (la « VNI Garantie ») observée 12 mois auparavant à une date pouvant être considérée comme une date d'observation (la « Date d'Observation »). Les ordres de rachat des actionnaires du compartiment demandant le rachat de leurs actions à une Date d'Observation seront fondés sur un prix de rachat au moins égal à 80% de la VNI (hors dividendes, le cas échéant) de la classe d'actions dont ils demandent le rachat (la « VNI Garantie ») observée le 3^e vendredi du même mois 12 mois auparavant (la « Date d'Observation »).

La Société publie les informations requises par la loi au Grand-Duché de Luxembourg et dans tous les autres pays où les actions sont proposées au public.

Ces informations sont également disponibles sur le site Internet : www.bnpparibas-am.com.

Exercice

L'exercice de la Société commence le 1 janvier et se termine le 31 décembre.

Rapports financiers

La Société publie un rapport annuel clôturé le dernier jour de l'exercice, certifié par les réviseurs d'entreprises, ainsi qu'un rapport semi-annuel non certifié clôturé le dernier jour du premier semestre de l'exercice. Elle est autorisée à publier une version simplifiée des rapports financiers s'il y a lieu.

Les rapports financiers des différents compartiments sont établis dans la devise comptable de chaque compartiment, bien que les comptes combinés soient libellés en euro.

Le rapport annuel est publié dans les quatre mois de la clôture de l'exercice et le rapport semi-annuel, dans les deux mois de la fin du semestre considéré.

Documents disponibles pour consultation

Les Statuts, le Prospectus, les DIC et les rapports périodiques peuvent être consultés au siège social de la Société et auprès des établissements chargés des services financiers de la Société. Des exemplaires des Statuts et des rapports annuels et semi-annuels sont disponibles sur demande.

A l'exception des publications dans la presse requises par la loi, le média officiel d'où obtenir tout avis aux actionnaires à l'avenir sera notre site Internet www.bnpparibas-am.com.

Des documents et informations sont également disponibles sur le site Internet : www.bnpparibas-am.com.

Rapport de gestion

Conjoncture

Depuis début 2023, l'instabilité du consensus économique a entraîné une forte volatilité sur les classes d'actifs, en particulier les marchés obligataires, encore renforcée par deux événements exceptionnels à partir de mars. D'une part les difficultés de plusieurs banques régionales américaines et une contagion, très limitée, à certaines banques européennes qui ont réveillé le spectre de la crise financière. D'autre part, les négociations laborieuses et tendues entre l'Administration Biden et le Congrès dominé par les Républicains au sujet du plafond de la dette aux Etats-Unis. Le risque d'une crise bancaire et financière mondiale a finalement pu être écarté grâce aux actions rapides et appropriées des autorités bancaires et à un accord de suspension jusqu'en 2025 du plafond de la dette américaine. Au fil des mois, le ralentissement de l'inflation a été confirmé : aux Etats-Unis, l'inflation sous-jacente mesurée par le déflateur des dépenses privées hors alimentaire et énergie est tombé à 3,2 % en glissement annuel en novembre, au plus bas depuis mars 2021. Même si elle se refuse à crier victoire, la Réserve fédérale américaine (« Fed ») semble considérer qu'elle a réussi l'atterrissage en douceur de l'économie américaine. Face à ces résultats, et alors que les enquêtes d'activité pointent vers une croissance mondiale morose (avec d'importantes disparités), le cycle de remontée des taux directeurs s'est achevé à l'automne 2023 et les investisseurs sont désormais convaincus que les banques centrales de la plupart des économies développées vont rapidement assouplir leurs politiques monétaires en 2024. Le retour de l'hypothèse dite du « pivot » a alimenté la progression des actions et des obligations au quatrième trimestre.

Etats-Unis

L'économie américaine est restée solide en 2023 : après une progression en rythme annualisé de 2,2 % au premier trimestre de 2023, 2,1 % au second et 4,9 % au troisième, les indicateurs disponibles pour le quatrième trimestre laissent envisager une progression de 2,0 % à 2,5 % selon le calcul GDPNow proposé par la Fed d'Atlanta. Les craintes de voir la demande intérieure s'affaiblir sous l'effet de la remontée agressive des taux directeurs de la Fed ne se sont donc pas matérialisées, notamment grâce à la bonne tenue du marché du travail et au dynamisme de la consommation entretenu par le recours au surplus d'épargne résultant des nombreuses mesures de soutien pendant et après la pandémie. En novembre, la consommation privée en terme réel a augmenté de 0,3 % (après 0,1 % en octobre, chiffre revu à la baisse), ce qui assure un acquis de 2,1 % (en rythme annualisé) de cette composante importante pour le quatrième trimestre. L'hypothèse d'un ralentissement plus précoce de l'activité, qui ne s'est pas matérialisée, s'appuyait sur le rééquilibrage du marché du travail qui a tardé à être observé. De premiers signes, encore timides, sont désormais visibles. En 2023, 2,7 millions d'emplois ont été créés (après 4,8 millions en 2022) avec un essoufflement du rythme au fil des mois. La moyenne mensuelle des créations au dernier trimestre ressort à 165 000 contre 225 000 pour l'ensemble de 2023. Le taux de chômage termine l'année à 3,7 %. Le pourcentage de chômeurs ayant volontairement quitté leur emploi (13,4 %) est désormais bien inférieur au niveau de début 2023 (15,3 %). Enfin, un élément crucial du rééquilibrage du marché du travail est le ralentissement de la hausse des salaires horaires (à 4,3 % en glissement annuel pour les employés non chargés d'encadrement contre plus de 5 % au premier trimestre).

Europe

Dans la zone euro, l'économie a stagné en 2023 sous l'effet de la remontée des taux directeurs et du resserrement des conditions financières ainsi que du ralentissement structurel en Allemagne. Le PIB a progressé très modestement aux premier et second trimestres (+0,1 %), s'est contracté de 0,1 % au troisième trimestre et vraisemblablement au quatrième où le niveau moyen de l'indice PMI (Purchasing Manager Index) composite est ressorti à 47,2. Ce niveau, légèrement plus bas qu'au troisième trimestre, correspond à une situation de récession. En glissement annuel, la croissance du PIB est passée de 1,7 % au quatrième trimestre de 2022 à 0,0 % au troisième trimestre de 2023. Toutefois, au vu des enquêtes d'activité, de nombreux observateurs avaient envisagé que la conjoncture se dégraderait plus fortement et plus rapidement. Il s'avère que l'économie de la zone euro a mieux résisté que prévu au choc énergétique, d'une part, et que la demande pour les services a été très forte au printemps, d'autre part. A contrario, l'activité a ralenti dans le secteur manufacturier, en particulier en Allemagne. La solidité de marché du travail (taux de chômage à 6,5 % depuis avril, croissance de l'emploi de 0,4 % / 0,5 % fin 2022 et début 2023) peut expliquer cette résistance. Ce phénomène entraîne aussi une hausse des coûts salariaux qui commence à préoccuper la Banque centrale européenne (« BCE »). Notons toutefois que la croissance de l'emploi s'est essouffée aux second et troisième trimestres et que les enquêtes auprès des entreprises font état d'une dégradation au dernier trimestre. Le glissement annuel de l'indice des prix à la consommation est passé de 8,6 % en janvier à 2,9 % en octobre puis 2,4 % en novembre. L'inflation sous-jacente, qui dépassait encore 5 % en août, est tombée à 3,6 % en novembre, au plus bas depuis avril 2022.

Rapport de gestion

Japon

La Banque du Japon (« BoJ ») est longtemps restée à l'écart du resserrement généralisé de la politique monétaire dans les économies développées, considérant que l'accélération de l'inflation jusqu'à des niveaux qui n'avaient plus été enregistrés depuis 40 ans environ est un phénomène temporaire lié aux coûts de l'énergie et des produits importés. Toutefois, ces hausses de prix ont pesé fortement sur la confiance des ménages. Après la levée des dernières restrictions sanitaires qui ont persisté jusqu'à l'automne, l'optimisme est timidement revenu. Dans ce contexte, ce n'est que fin juillet que la BoJ a franchi le pas en annonçant que l'application de sa politique de contrôle de la courbe (YCC – Yield Curve Control) serait désormais plus « flexible ». Elle considère que les effets secondaires de la politique ultra accommodante sont de plus en plus préoccupants. Les annonces sont toutefois restées suffisamment ambiguës pour permettre au Gouverneur Ueda d'affirmer qu'il ne s'agit pas de la première étape d'une normalisation. Malgré tout, il a procédé à d'autres ajustements au second semestre. Le 31 octobre, la BoJ a annoncé ce jour-là que le seuil de 1 % pour le rendement du JGB à 10 ans n'est plus désormais une limite stricte à défendre, donnant ainsi un peu plus de flexibilité à la YCC sans modifier les autres paramètres. Après avoir progressé de 1,2 % au premier puis de 0,9 % au second, le PIB s'est contracté de 0,7 % au troisième trimestre où les comptes nationaux ont fait ressortir la faiblesse de la demande intérieure. Les enquêtes d'activité ont été encourageantes en fin d'année. Les résultats de l'enquête trimestrielle Tankan de conjoncture de la Banque du Japon (« BoJ ») ont nettement dépassé les attentes. La confiance des grandes entreprises dans le secteur manufacturier a retrouvé son plus haut niveau en près de deux ans. Le secteur des services paraît encore plus dynamique avec un indice au plus haut depuis 1991 pour les grandes entreprises. Le déflateur du PIB a été révisé à la hausse et ressort à 5,3 % en glissement annuel au troisième trimestre (après 3,8 % au second trimestre). Cette accélération survient alors que le déflateur des importations est négatif depuis deux trimestres (3,1 % puis -7,8 % en glissement annuel). L'inflation, qui est désormais liée à la demande intérieure, a ralenti en novembre : l'inflation totale est ressortie à 2,8 % (après 3,3 % en octobre) tandis que l'inflation hors produits frais et énergie est passée de 4,0 % en octobre à 3,8 % en novembre. Toutefois, l'inflation sous-jacente dans les services a accéléré de 2,1 % à 2,3 % en raison de la hausse des tarifs hôteliers. En toute fin d'année, le Gouverneur Ueda n'a pas hésité à déclarer que « le comportement des entreprises en matière de fixation des salaires et des prix évoluent et la probabilité d'atteindre l'objectif de stabilité des prix de 2 % de manière durable et stable augmente progressivement ». Il semble que des dissensions existent au sein du comité et que la position du gouverneur est peut-être plus hawkish que celle de la majorité. Le compte-rendu des discussions publié le 27 décembre (Summary of opinions) a renforcé cette impression : les débats sur la normalisation de la politique monétaire s'intensifient, mais un consensus n'a pas encore été atteint entre les membres qui veulent être certains de l'orientation de l'inflation et ceux qui sont favorables à une approche proactive de la politique monétaire.

Marchés émergents

En 2022, la croissance du PIB chinois est ressortie à seulement 3,0 % en moyenne, soit un chiffre largement inférieur à l'objectif initial du gouvernement. Pour 2023, l'objectif de croissance de 5 % est réalisable même si les enquêtes d'activité en fin d'année continuent d'envoyer des signaux mitigés. Les données objectives pour novembre correspondent à une croissance assez solide au quatrième trimestre tout en confirmant la faiblesse du secteur immobilier. La production industrielle a progressé de 6,6 % en glissement annuel, au-dessus des attentes et à son rythme le plus rapide depuis février 2022. Les ventes au détail sont en hausse de 10,1 % en glissement annuel (après 7,6 % en septembre), légèrement en dessous des attentes, et ont reculé de -0,1 % en glissement mensuel. Les effets de base sont importants car la stratégie zéro-Covid était toujours en vigueur en novembre 2022. En plus des baisses de taux annoncées par la People's Bank of China (« PBoC »), après avoir tergiversé, les autorités ont multiplié les annonces en fin d'année, laissant espérer de nouvelles mesures de soutien sur de nombreux plans pour stabiliser la croissance et l'emploi. A l'issue de la conférence annuelle centrale sur le travail économique (Central Economic Work Conference – CEWC), les autorités ont reconnu que « pour continuer de rétablir davantage l'économie, la Chine doit encore surmonter certaines difficultés et certains défis ». Le CEWC a rappelé l'importance de l'amélioration de la qualité et de l'efficacité de la croissance et la nécessité d'assurer une transition sans heurts des modèles de croissance pour stabiliser les anticipations des agents économiques. Un paragraphe est consacré aux difficultés du secteur immobilier qui augmentent le risque de déflation. En novembre, l'inflation s'est inscrite à -0,5 % en glissement annuel (après -0,2 % en octobre). En considérant les autres zones émergentes dans leur ensemble, la croissance en 2023 s'est révélé plus résistante qu'attendu, en particulier en Asie émergente qui a profité de dynamisme de l'économie américaine. La demande extérieure a été soutenue par une reprise des exportations de semi-conducteurs et cette tendance devrait se poursuivre (super-cycle). Après une décélération significative, l'inflation sous-jacente s'est stabilisée depuis 3 à 4 mois et reste supérieure à sa moyenne historique dans de nombreux pays émergents. Comme elle l'avait annoncé, la Banque centrale du Brésil a abaissé son taux directeur de 50pb en décembre, portant le SELIC à 11,75 % et confirmé que les baisses « de même ampleur » allaient se poursuivre lors des prochaines réunions. Depuis le début de l'assouplissement en août, le SELIC a été abaissé de 200pb. L'inflation est ressortie à 4,68 % en glissement annuel en novembre, un niveau compatible avec l'objectif de 3,25 % (+/- 150pb). En Turquie, alors que l'inflation semble sur un plateau au-dessus de 60 % en glissement annuel depuis septembre (61,98 % en novembre), la Banque centrale a relevé son taux directeur de 250pb à 42,5 %, ralentissant le rythme après trois hausses consécutives de 500pb (en septembre, octobre et novembre) et alors que le taux s'établissait à 8,50 % jusqu'en mai. Le communiqué indique que le resserrement monétaire est « proche du niveau requis pour établir le cap de la désinflation ».

Rapport de gestion

Politique monétaire

Après avoir mis en place un rythme très soutenu de resserrement de sa politique monétaire au second semestre 2022 en insistant sur une inflation « généralisée et trop élevée », la Réserve fédérale américaine (« Fed ») a opté pour des pas de 25pb en 2023 et des hausses moins régulières. Tout au long du premier semestre, la Fed a dû lutter contre les anticipations d'une fin proche du cycle de remontée. Le taux objectif des fonds fédéraux a été porté dans l'intervalle 5,00 % - 5,25 % avant un statu quo le 14 juin. A l'issue de la réunion du FOMC des 25 et 26 juillet, la Fed a augmenté son taux de directeur de 25pb avant un statu quo (bien anticipé à chaque fois) lors des trois réunions qui ont suivi. Le taux objectif des fonds fédéraux évolue désormais dans l'intervalle 5,25 % - 5,50 %, soit une hausse de 100pb en 2023 et de 525pb depuis le début du resserrement en mars 2022. Entre septembre, où la décision de ne pas remonter les taux directeurs pouvait encore être interprétée comme une nouvelle pause dans le cycle, et décembre, le discours de la Fed est devenu beaucoup plus accommodant, vraisemblablement parce que l'inflation a enfin reflué et que certains membres du Federal open market committee (« FOMC ») estiment que les « indications d'un ralentissement de l'économie se multiplient ». Le compte rendu de la réunion de septembre a notamment révélé que, pour certains, le risque de « trop remonter » les taux directeurs existe, et que les discussions doivent désormais porter sur la durée de la politique restrictive et non plus sur son degré. En décembre, Jerome Powell a signalé que la politique monétaire est désormais « nettement en territoire restrictif ». Par ailleurs, les projections concernant le niveau du taux des fonds fédéraux jugé « approprié » par les membres du FOMC ont révélé qu'un assouplissement de la politique monétaire pourrait devenir une réalité au premier semestre 2024. En septembre, dix membres du comité pensaient que le taux des fonds fédéraux serait encore supérieur à 5 % à la fin de 2024. Seuls trois d'entre eux s'y attendent désormais. Par rapport à septembre, l'estimation médiane a diminué de 50pb à 4,625 % (ce qui correspond à 3 baisses de 25pb). Les anticipations de baisse rapide des taux directeurs en 2024, qui étaient déjà fortes avant la réunion de décembre, se sont alors « emballées ». Fin 2023, le marché Overnight swap index (« OIS ») fait ressortir l'équivalent de 7 baisses de 25pb des taux directeurs en 2024 avec une probabilité élevée d'une première baisse en mars. Face au ralentissement de l'inflation, le FOMC a révisé à la baisse ses attentes pour l'inflation core PCE fin 2023 (à 3,2 % contre 3,7 % prévu en septembre), fin 2024 (2,4 %) et fin 2025 (2,2 %). Dans le même temps, le FOMC prévoit une hausse modérée du taux de chômage (à 4,1 % de 2024 à 2026), qui resterait ainsi proche de son niveau d'équilibre (4,0 %). Le scénario central de la Fed correspond à une situation idéale avec le retour de l'inflation vers l'objectif sans freinage brutal de l'activité.

En 2023, la BCE a commencé par remonter ses trois directeurs de 50pb en février et mars, puis de 25pb en mai, juin, juillet et septembre, portant le taux de dépôt à 4,00 %, la facilité de prêt marginal à 4,75 % et les opérations principales de refinancement à 4,50 %. Depuis le début de la hausse en juillet 2022, les taux ont été remontés de 450pb. La communication de la BCE a laissé entendre que cette hausse serait la dernière du cycle et des commentaires ultérieurs ont indiqué que le choix entre statu quo et hausse en septembre avait été difficile compte tenu d'un environnement particulièrement incertain. De fait la BCE est confrontée à une situation délicate où le marché du travail reste tendu mais où l'activité des entreprises souffre de la baisse de la demande. A l'occasion de sa conférence de presse qui a accompagné ce qui était alors présenté comme une « pause » le 26 octobre, Christine Lagarde a reconnu que la transmission de la politique monétaire était « vigoureuse, freinant la demande et contribuant ainsi au ralentissement de l'inflation ». Par ailleurs, la croissance dans la zone euro, et particulièrement en Allemagne, reste déprimée et la faiblesse de la demande commence à peser sur l'emploi. La publication des Minutes de la réunion du 26 octobre a révélé que les discussions avaient porté sur les risques baissiers sur la croissance. Dans ce contexte, le message qui a accompagné le statu quo attendu en décembre a été jugé plutôt hawkish, à rebours de certaines déclarations qui avaient animé les premiers jours de décembre. Le Conseil des gouverneurs a tenu à répéter qu'il était « trop tôt pour déclarer victoire dans le combat contre l'inflation » en raison de « pressions toujours élevées sur les prix domestiques du fait de la solide croissance des coûts salariaux unitaires ». Par ailleurs, le Conseil des gouverneurs a également décidé d'avancer la normalisation du bilan de l'Eurosystème en réduisant le portefeuille du PEPP (programme d'achats d'urgence face à la pandémie - pandemic emergency purchase programme) de 7,5 milliards d'euros par mois en moyenne au second semestre 2024 et en mettant un terme aux réinvestissements fin 2024. Enfin, Christine Lagarde a indiqué que le Conseil n'avait pas discuté des baisses de taux. Les anticipations de baisses rapides des taux en 2024 se sont malgré tout renforcées. Fin décembre, les niveaux sur l'Overnight Index Swap (« OIS ») font ressortir 3 baisses de 25pb au premier semestre.

Rapport de gestion

Marchés des changes

Après une hausse de 8,5 % du dollar en 2022, l'indice DXY (calculé face à un panier regroupant l'euro, le yen, la livre sterling, le dollar canadien, la couronne suédoise et le franc suisse) a évolué sans grande direction en 2023, enregistrant un recul de 2,7 %.

Dès le début de 2023, la parité EUR/USD, qui s'inscrivait à 1,0705 fin 2022, a connu des variations heurtées, au gré des décisions et des anticipations sur la politique monétaire de part et d'autre de l'Atlantique. Le marché des changes a ainsi souvent réagi au cours de l'année aux chiffres d'inflation. Le différentiel de croissance entre la zone euro et les Etats Unis a également été pris en compte. Tous ces éléments expliquent pourquoi il est difficile d'isoler une tendance pour la parité au cours des douze derniers mois. En mars, les incidents sur le secteur bancaire ont entraîné des mouvements encore plus erratiques, l'euro et le dollar étant chahutés tour à tour. Ce thème est sorti des préoccupations sur le marché des changes dès qu'il est apparu que le risque systémique pouvait être écarté dans la zone euro (réglementation et stricte surveillance exercée par la BCE). Après avoir évolué entre un peu plus de 1,12 en juillet (au plus haut depuis février 2022), alors que le dollar était pénalisé par une inflation moins élevée qu'attendu aux Etats-Unis, et moins de 1,05 début octobre, après des indicateurs économiques très dégradés dans la zone euro, la parité a gagné 3,1 % en un an et termine à 1,1039.

Le yen s'est orienté à la baisse dès le début de l'année, ne bénéficiant que très ponctuellement de son statut de devise refuge lors des inquiétudes suscitées par la faillite des banques régionales américaines en mars. Les variations de la parité USD/JPY ont été très heurtées à cette occasion. Même si l'hypothèse, confirmée en partie par des annonces fin juillet, d'un ajustement de la politique monétaire de la Banque du Japon (« BoJ ») a, un temps, soutenu le yen, le différentiel de taux entre le Japon et les autres grandes économies développées, propice aux stratégies de carry trade, reste très important. Les investisseurs sont toutefois devenus plus prudents sur ces opérations qu'ils ne l'ont été par le passé, craignant de nouvelles interventions directes sur le marché des changes en cas de baisse trop marquée du yen. La parité USD/JPY (131,12 fin 2022) est passée au-dessus de 151 après le nouvel ajustement de politique monétaire du 31 octobre. Cette décision et des déclarations ultérieures du Gouverneur Ueda ont conduit certains observateurs à attendre des changements plus agressifs avant la fin de l'année, ce qui a soutenu le yen. Malgré le statu quo annoncé le 19 décembre, la parité USD/JPY est revenue vers 140, au plus bas depuis juillet, dans la mesure où l'évolution du différentiel de politique monétaire dans les prochains mois devrait être de plus en plus favorable à la devise japonaise, ses homologues s'engageant sur le chemin de la baisse de leurs taux directeurs. La parité USD/JPY termine l'année à 141,04, soit une baisse du yen de 7,0 % face au dollar (malgré une appréciation de près de 6 % au quatrième trimestre).

Marchés obligataires

Tout au long de l'année, les fluctuations des anticipations de politique monétaire ont entraîné une forte hausse de la volatilité (implicite et réalisée) sur toutes les maturités et en particulier sur les échéances les plus courtes. Ces mouvements ont été exacerbés mi-mars par les faillites de plusieurs banques régionales américaines. Les marchés ont également été animés au printemps par le débat sur le plafond de la dette américaine et un hypothétique défaut technique des Etats-Unis à l'origine de fortes variations sur le marché des Credit Default Swap (« CDS ») et sur les taux des titres du Trésor très courts. Au-delà de ces éléments particuliers, ces mouvements violents traduisent surtout la fébrilité des investisseurs. Les variations trimestrielles du rendement du T-note à 10 ans reflètent ces atermoiements : 41pb au premier trimestre, +19pb au second, +73pb au troisième et enfin -69pb au quatrième trimestre. Le taux américain à 10 ans (3,87 % fin 2022) a connu des variations heurtées dès le début de l'année. Il s'est inscrit sous 3,40 mi-mars et, malgré la rapide réaction des autorités pour garantir l'ensemble des dépôts des banques régionales en faillite, les taux longs ne se sont pas immédiatement redressés. Les investisseurs craignaient alors que la récession engendrée par une éventuelle crise bancaire ne contraigne la Fed à baisser agressivement ses taux directeurs. Ces inquiétudes se sont dissipées en mai. Les taux se sont alors orientés à la hausse alors que d'autres facteurs entraînent en ligne de compte au fil des mois (propos très hawkish tenus par les banquiers centraux réunis à Sintra fin juin, indicateurs économiques solides). Les tensions sur les rendements obligataires se sont accentuées et, le 23 octobre, le rendement du T-note américain à 10 ans est ponctuellement passé au-dessus du seuil symbolique de 5,00 %, pour la première fois depuis 2007. Même si la Secrétaire au Trésor a réfuté cette explication, de telles tensions peuvent refléter des interrogations sur la soutenabilité de la dette souveraine américaine. Celles-ci ont d'ailleurs été exprimées par les agences de notation. Notons que le changement de direction des taux longs à partir de leur point haut du 23 octobre valide a posteriori l'analyse de Janet Yellen. En novembre et décembre, les investisseurs ont privilégié deux éléments : le ralentissement de l'inflation et des commentaires moins hawkish de la Fed à l'origine d'anticipations de baisses rapides et nombreuses des taux directeurs en 2024. Le rendement du T-note à 10 ans a connu une détente pratiquement ininterrompue qui l'a amené sous 3,80 % le 27 décembre, au plus bas depuis le 19 juillet. Il a terminé l'année à 3,88 % au niveau qui prévalait fin 2022. Le taux à 2 ans (4,43 % fin 2022), est passé au-dessus de 5,00 % début mars puis est brutalement retombé à 3,80 % au moment de la crise des banques régionales. Il a évolué autour de ce niveau jusqu'en mai avant de repartir à la hausse. Il s'est alors hissé au-dessus de 5,20 % en octobre et termine l'année à 4,25 %.

Rapport de gestion

L'évolution des marchés obligataires de la zone euro a été guidée par les anticipations sur la politique monétaire de la BCE et de la Fed et, bien évidemment, par les événements qui ont affecté les banques en mars, aux Etats-Unis puis en Europe. Notons toutefois que le marché interbancaire n'a été à aucun moment perturbé, ce qui montre la confiance des établissements de la zone euro les uns envers les autres. Au premier trimestre, l'évolution du rendement du Bund allemand à 10 ans a été heurtée entre 2,00 % et 2,75 %. A plusieurs reprises, les variations des marchés ont été exacerbées par la réaction de certains investisseurs pris à contre-pied et contraints d'ajuster brutalement leurs positions. C'est le cas pour la détente qui a suivi la remontée de 50pb des taux directeurs de la BCE le 16 mars et a ponctuellement entraîné le rendement du Bund allemand à 10 ans sous 2,00 % en séance le 24 sur fond d'inquiétudes grandissantes pour les banques européennes. Une fois éloigné le risque d'une crise financière systémique, le rendement du Bund allemand à 10 ans a évolué sans tendance entre 2,20 % et 2,50 % au second trimestre, ne passant que très ponctuellement au-dessus de 2,50 %, à chaque fois entraîné par un mouvement international (négociations sur le plafond de la dette aux Etats-Unis, données sur l'inflation au Royaume-Uni). Ce n'est qu'à partir de juillet, dans le sillage des taux longs américains, qu'il a franchi plus durablement ce seuil de 2,50 %, qui était apparu jusque-là comme une forte résistance. Après une évolution heurtée durant l'été, il a atteint 2,97 % début octobre. Comme les rendements aux Etats-Unis, et malgré un discours toujours hawkish de la BCE, le taux allemand à 10 ans a ensuite connu une très nette détente, accentuée par la conjoncture dégradée de la zone euro et le ralentissement de l'inflation. Le rendement du Bund à 10 ans est retombé à 1,90 % le 27 décembre, au plus bas en plus d'un an, alors que l'activité était très réduite au cours de la dernière semaine de l'année. Il a terminé 2023 à 2,02 % (-55pb par rapport à fin 2022). Les conclusions du Conseil des gouverneurs du 14 décembre ne sont pourtant pas apparues particulièrement dovish, mais les déclarations ultérieures de plusieurs gouverneurs confirmant qu'il était trop tôt pour envisager des baisses de taux ne sont pas parvenues à modifier les attentes des investisseurs. Le taux allemand à 2 ans (2,76 % fin 2022), a connu de violentes fluctuations entre 2,35 % et 3,25 % pour terminer l'année à 2,40 % après avoir retrouvé quelques jours auparavant son plus bas depuis la mini-crise déclenchée par les faillites de plusieurs banques régionales américaines.

Marchés actions

En 2023, l'instabilité du consensus économique a entraîné une forte volatilité sur toutes les classes d'actifs. En janvier, l'hypothèse d'un resserrement monétaire devenant rapidement moins agressif a permis aux actions mondiales de connaître un très bon début d'année. En février au contraire, des indicateurs économiques meilleurs qu'attendu ont remis en cause cette idée du « pivot ». En mars, les difficultés de plusieurs banques régionales américaines et une contagion, très limitée, à l'Europe ont réveillé le spectre de la crise financière. Grâce à la réaction rapide des autorités, les actions ont terminé le premier trimestre de 2023 en forte hausse (+6,8 % pour l'indice MSCI AC World en dollars) mais les anticipations de politique monétaire ne se sont pas stabilisées. La hausse des actions mondiales a continué au second trimestre (+5,6 %) alimentée par les bons résultats des entreprises américaines et l'engouement pour les valeurs susceptibles de profiter de l'essor de l'intelligence artificielle. Elle s'est prolongée en juillet avant de céder la place à trois reculs mensuels consécutifs en raison des violentes tensions survenues sur les rendements (nominaux et réels) des obligations gouvernementales. Après un recul de 3,8 % au troisième trimestre, le quatrième a mal commencé, le risque géopolitique revenant au premier plan avec les terribles attentats en Israël le 7 octobre. Cet événement est survenu alors que les investisseurs étaient confrontés à des tensions accrues sur les taux longs. La résistance de l'économie américaine (hausse du PIB de 4,9 % en rythme annualisé au troisième trimestre, solides créations d'emploi, consommation dynamique) et une inflation supérieure aux attentes expliquent le comportement du marché obligataire. A partir de novembre, le retour des anticipations de baisse rapide des taux directeurs en 2024 a gouverné les évolutions des marchés financiers, entraînant une nette détente des rendements obligataires et un rebond des actions. Ce thème a dominé jusqu'à la fin de l'année, alimenté par le reflux significatif de l'inflation en octobre et novembre puis par les commentaires et les prévisions de la Réserve fédérale américaine (« Fed ») en décembre. Au fil des semaines, les investisseurs se sont mis à anticiper de plus en plus de baisses de taux survenant de plus en plus tôt. Dans ce contexte, les actions mondiales ont terminé le trimestre en hausse de 10,7 %, enregistrant ainsi une progression annuelle de 20,1 %.

La situation conjoncturelle en Chine a été l'autre élément crucial en 2023. La sortie de la politique zéro-Covid à l'automne 2022 a, dans un premier temps, suscité de nombreux espoirs et soutenu les actions émergentes jusqu'à fin janvier sur le thème de la réouverture de l'économie chinoise. Au fil des mois, les déceptions sur la croissance ont commencé à inquiéter les investisseurs qui espéraient une réponse plus énergique des autorités. Dans ce contexte pour le moins agité (avec les difficultés persistantes du secteur immobilier), les actions émergentes ont enregistré une hausse de 7,0 % seulement en 2023 (indice MSCI Emerging markets en dollars), pénalisées par le recul des indices chinois (13,3 % pour le MSCI China) qui a aussi limité la hausse de l'indice MSCI AC Asia ex Japan (+3,6 %).

Rapport de gestion

Parmi les places développées, les indices américains ont surperformé (résistance de l'activité, poids des valeurs de croissance et du secteur technologique). Le S&P 500 s'est rapproché fin décembre de son record en clôture établi le 3 janvier 2022 et progresse de 24,4 % grâce à la hausse spectaculaire d'un très petit nombre de valeurs. Le Nasdaq Composite a bondi de 43,4 % emporté par la frénésie autour de l'intelligence artificielle et les semi-conducteurs. Dans la zone euro, les indices EURO STOXX 50 et MSCI EMU ont progressé de 19,2 % et de 16 % respectivement (en euros). Plusieurs indices ont battu leurs précédents records courant décembre. La Bourse de Tokyo (+28,2 pour le Nikkei 225 ; +25,1 % pour le TOPIX) a connu un très bon premier semestre avant de sous-performer en raison des perspectives de l'abandon par la Banque du Japon de sa politique monétaire ultra-accommodante. Les performances sont celles des indices en devises locales, dividendes non réinvestis. Au niveau mondial, les valeurs technologiques et, tout particulièrement, les semi-conducteurs, ont nettement surperformé tout comme le style croissance avec une hausse de +32,1 % pour l'indice MSCI World Growth contre 8,8 % pour l'indice MSCI World Value.

Le Conseil d'Administration

Luxembourg, le 2 février 2024

Remarque : les informations figurant dans ce rapport se réfèrent à des performances passées et ne présument en rien des résultats futurs.

Rapport d'audit

Aux Actionnaires de
BNP Paribas Funds

Notre opinion

A notre avis, les états financiers ci-joints donnent une image fidèle et sincère de la situation financière de BNP Paribas Funds (le « Fonds ») et de chacun de ses compartiments au 31 décembre 2023, ainsi que du résultat de leurs opérations et des changements des actifs nets pour l'exercice clos à cette date, conformément aux prescriptions légales et réglementaires relatives à l'établissement et la présentation des états financiers en vigueur au Luxembourg.

Objet de notre audit

Les états financiers du Fonds comprennent :

- l'état des actifs nets au 31 décembre 2023 ;
- le portefeuille-titres au 31 décembre 2023 ;
- l'état des opérations et des changements des actifs nets pour l'exercice clos à cette date ; et
- les notes aux états financiers, y compris un résumé des principales méthodes comptables.

Fondements de l'opinion

Nous avons effectué notre audit selon la Loi du 23 juillet 2016 relative à la profession de l'audit (Loi du 23 juillet 2016) et les Normes Internationales d'Audit (NIA), telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Nos responsabilités conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux NIA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF sont plus amplement décrites à la section « Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé relatives à l'audit des états financiers » de notre rapport.

Nous estimons que les éléments probants recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Nous agissons indépendamment du Fonds, conformément au Code de déontologie pour les Comptables professionnels, incluant les Normes internationales d'indépendance, du Conseil des normes internationales de déontologie comptable (International Ethics Standards Board for Accountants) (le Code IESBA), tel qu'adopté pour le Luxembourg par la CSSF, ainsi qu'aux exigences déontologiques applicables à notre audit des états financiers. Nous avons respecté l'ensemble de nos autres responsabilités déontologiques en vertu desdites exigences.

Point d'attention

Nous attirons l'attention sur la note 2 de ces états financiers, qui indique que le Conseil d'Administration du Fonds a décidé de suspendre le calcul de la valeur nette d'inventaire, l'émission et le rachat et la conversion des actions des compartiments Russia Equity à compter du 25 février 2022 et Europe Emerging Equity à compter du 28 février 2022 suite aux tensions géopolitiques persistantes et aux sanctions imposées à la Russie. Notre opinion n'est pas modifiée à cet égard.

Autres informations

Le Conseil d'Administration du Fonds est responsable des autres informations. Les autres informations comprennent les informations figurant dans le rapport annuel, mais n'intègrent pas les états financiers et notre rapport d'audit y relatif.

Notre opinion sur les états financiers ne couvre pas les autres informations, et nous n'exprimons à leur endroit aucune forme de conclusion avec assurance.

Dans le cadre de notre vérification des états financiers, notre responsabilité est de lire les autres informations identifiées ci-dessus, et ce faisant, d'évaluer si ces autres informations sont matériellement incohérentes avec les états financiers ou les connaissances que nous avons obtenues dans le cadre de l'audit, ou semblent contenir d'autres anomalies significatives. Si, en fonction du travail que nous avons effectué, nous concluons que ces autres informations contiennent des anomalies significatives, nous sommes tenus de le signaler. Nous n'avons rien à signaler à ce sujet.

Responsabilités du Conseil d'Administration du Fonds à l'égard des états financiers

Le Conseil d'Administration du Fonds est responsable de l'établissement et de la présentation sincère des états financiers, conformément aux prescriptions légales et réglementaires relatives à l'établissement et la présentation des états financiers en vigueur au Luxembourg, ainsi que d'un contrôle interne qu'il juge nécessaire pour permettre l'établissement d'états financiers ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Lors de l'établissement des états financiers, le Conseil d'Administration du Fonds est en charge de l'évaluation de la capacité du Fonds et de chacun de ses compartiments à poursuivre leurs activités, en déclarant, le cas échéant, les éléments y ayant trait et en ayant recours au principe comptable de continuité de l'exploitation, sauf si le Conseil d'Administration du Fonds a l'intention de procéder à leur liquidation ou de mettre fin à leurs activités, ou qu'il ne dispose d'aucune alternative réaliste à ces deux options.

Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé relatives à l'audit des états financiers

L'objectif de notre audit est d'obtenir une assurance raisonnable que les états financiers dans leur ensemble ne contiennent pas d'anomalies significatives, qu'elles résultent de fraudes ou d'erreurs, ainsi que d'établir un rapport d'audit qui contient notre opinion. L'« assurance raisonnable » correspond à un fort degré d'assurance, mais ne garantit pas qu'un audit effectué conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux NIA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF permettra toujours de détecter une anomalie significative, le cas échéant. Des anomalies peuvent survenir à la suite de fraudes ou d'erreurs, et sont considérées comme significatives si, prises individuellement ou de manière collective, elles sont susceptibles d'influencer les décisions économiques prises sur la base de ces états financiers.

Dans le cadre de l'audit, et conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux NIA, telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous faisons preuve d'un jugement et d'un scepticisme professionnels tout au long de l'audit. Nos responsabilités consistent également à :

- identifier et évaluer les risques qu'il existe une anomalie significative dans les états financiers, que celle-ci résulte de fraudes ou d'erreurs ; établir et suivre des procédures d'audit en fonction de ces risques et obtenir des éléments probants suffisants et adéquats pour servir de base à notre opinion. Le risque de ne pas détecter les anomalies significatives qui résultent d'une fraude est plus élevé que lorsqu'elles apparaissent à la suite d'erreurs, en cela qu'une fraude peut prendre la forme de collusion, falsification, omission intentionnelle, présentation déformée ou non-respect des contrôles internes ;



- comprendre le contrôle interne applicable à l'audit afin de définir des procédures d'audit appropriées en la circonstance, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité dudit contrôle ;
- apprécier l'adéquation des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables et déclarations connexes faites par le Conseil d'Administration du Fonds ;
- décider du caractère approprié du recours au principe comptable de continuité de l'exploitation par le Conseil d'Administration du Fonds et, sur la base des éléments probants recueillis, déterminer s'il existe une incertitude significative concernant des événements ou circonstances qui pourraient jeter un doute important quant à la capacité du Fonds ou de l'un de ses compartiments à poursuivre ses activités. Si nous identifions une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention dans notre rapport d'audit sur les déclarations concernées dans les états financiers ou, si celles-ci sont inappropriées, de modifier notre opinion. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants recueillis jusqu'à la date d'établissement de notre rapport d'audit. Néanmoins, des événements ou circonstances ultérieur(e)s pourraient entraîner une cessation des activités du Fonds ou de l'un de ses compartiments ;
- évaluer la présentation, la structure et le contenu d'ensemble des états financiers, y compris les déclarations connexes, et vérifier que ces derniers présentent les transactions et événements sous-jacents de manière équitable.

Nous restons en contact avec les personnes en charge de la gouvernance s'agissant entre autres de l'étendue et du calendrier prévus pour l'audit ainsi que les conclusions importantes qui en ressortent, y compris toute insuffisance substantielle au niveau du contrôle interne que nous identifions lors de notre audit.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Représentée par

Luxembourg, le 19 avril 2024

Sebastien Sadzot

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Absolute Return Global Opportunities | Aqua | Asia High Yield Bond | Asia Tech Innovators |
|---|---------------------|---|---------------|----------------------|----------------------|
| | Exprimé en Notes | EUR | EUR | USD | USD |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 0 | 3 756 212 786 | 65 999 918 | 21 002 478 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 0 | 2 939 869 320 | 68 489 062 | 18 483 883 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | 0 | 740 783 975 | (3 451 637) | 1 046 727 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 0 | 3 680 653 295 | 65 037 425 | 19 530 610 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 0 | 41 420 649 | 38 497 | 1 400 618 |
| Autres actifs | | 0 | 34 138 842 | 923 996 | 71 250 |
| Passif | | 0 | 14 148 639 | 180 079 | 88 767 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 1 633 858 | 137 348 | 96 |
| Autres passifs | | 0 | 12 514 781 | 42 731 | 88 671 |
| Valeur nette d'inventaire | | 0 | 3 742 064 147 | 65 819 839 | 20 913 711 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 10 453 | 61 718 568 | 3 514 511 | 470 617 |
| Commissions de gestion | 3 | 6 846 | 46 810 748 | 340 208 | 367 766 |
| Intérêts bancaires | | 0 | 22 243 | 2 563 | 193 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 0 | 24 250 | 0 |
| Autres frais | 6 | 2 412 | 11 324 809 | 109 665 | 117 371 |
| Taxes | 7 | 545 | 1 766 982 | 6 714 | 16 108 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 3 152 | 1 610 536 | 0 | 75 546 |
| Commissions de distribution | 4 | 258 | 1 590 712 | 0 | 7 |
| Total des charges | | 13 213 | 63 126 030 | 483 400 | 576 991 |
| Résultat net des investissements | | (2 760) | (1 407 462) | 3 031 111 | (106 374) |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (498 892) | 182 355 803 | (1 704 087) | (1 773 292) |
| Instruments financiers | 2 | 197 838 | 513 380 | 136 724 | (1 497) |
| Résultat net réalisé | | (303 814) | 181 461 721 | 1 463 748 | (1 881 163) |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 476 008 | 387 656 505 | (945 856) | 847 700 |
| Instruments financiers | | (171 966) | (1 862 037) | (137 348) | (96) |
| Résultat des opérations | | 228 | 567 256 189 | 380 544 | (1 033 559) |
| Emissions/(rachats) nets | | (10 974 967) | (266 549 645) | 8 120 050 | (433 348) |
| Dividendes distribués | 8 | 0 | (7 108 969) | (8 218 000) | 0 |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (10 974 739) | 293 597 575 | 282 594 | (1 466 907) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 10 974 739 | 3 448 466 572 | 65 537 245 | 22 380 618 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 0 | 3 742 064 147 | 65 819 839 | 20 913 711 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Belgium Equity | Brazil Equity | China A-Shares | China Equity | Climate Impact | Consumer Innovators |
|---------------------|---------------------|---------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| EUR | USD | USD | USD | EUR | EUR |
| 142 031 699 | 80 596 517 | 125 454 865 | 842 540 645 | 2 797 572 964 | 895 997 399 |
| 143 088 308 | 68 442 005 | 147 603 030 | 1 108 872 062 | 2 516 874 613 | 736 671 596 |
| (1 191 036) | 10 165 065 | (24 513 740) | (288 657 404) | 215 968 759 | 150 901 172 |
| 141 897 272 | 78 607 070 | 123 089 290 | 820 214 658 | 2 732 843 372 | 887 572 768 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 221 292 | 937 663 | 536 471 |
| 528 | 680 432 | 2 325 937 | 8 780 628 | 58 373 950 | 6 973 514 |
| 133 899 | 1 309 015 | 39 638 | 13 324 067 | 5 417 979 | 914 646 |
| 640 288 | 510 169 | 193 490 | 4 055 407 | 9 224 134 | 3 741 562 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 640 288 | 510 169 | 193 490 | 4 055 407 | 9 224 134 | 3 741 562 |
| 141 391 411 | 80 086 348 | 125 261 375 | 838 485 238 | 2 788 348 830 | 892 255 837 |
| 3 279 663 | 3 588 075 | 2 699 849 | 18 172 905 | 35 384 413 | 7 617 205 |
| 1 938 626 | 1 406 415 | 1 563 998 | 14 479 111 | 50 374 200 | 13 113 692 |
| 1 007 | 8 021 | 4 542 | 5 947 | 8 339 | 4 947 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 523 624 | 335 187 | 380 316 | 3 385 611 | 9 510 250 | 3 511 757 |
| 113 167 | 59 059 | 42 107 | 486 782 | 1 560 255 | 619 219 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 25 900 | 368 779 | 134 881 | 1 919 318 | 2 281 356 | 201 940 |
| 0 | 11 948 | 0 | 183 820 | 302 219 | 356 461 |
| 2 602 324 | 2 189 409 | 2 125 844 | 20 460 589 | 64 036 619 | 17 808 016 |
| 677 339 | 1 398 666 | 574 005 | (2 287 684) | (28 652 206) | (10 190 811) |
| 5 051 729 | 579 178 | (6 029 899) | (239 144 354) | 27 736 383 | (14 607 477) |
| 0 | 18 199 | (295 417) | (142 748) | 286 953 | 18 165 |
| 5 729 068 | 1 996 043 | (5 751 311) | (241 574 786) | (628 870) | (24 780 123) |
| (3 387 870) | 13 583 887 | (14 207 888) | 15 451 485 | 198 107 184 | 201 744 244 |
| 0 | 0 | 0 | 168 904 | 532 813 | 271 597 |
| 2 341 198 | 15 579 930 | (19 959 199) | (225 954 397) | 198 011 127 | 177 235 718 |
| (32 750 169) | (15 536 349) | (1 567 605) | (164 040 439) | (47 083 160) | (202 114 992) |
| (1 191 011) | (172 649) | (1 365) | (629 480) | (2 813 097) | (830 086) |
| (31 599 982) | (129 068) | (21 528 169) | (390 624 316) | 148 114 870 | (25 709 360) |
| 172 991 393 | 80 215 416 | 146 789 544 | 1 229 109 554 | 2 640 233 960 | 917 965 197 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 141 391 411 | 80 086 348 | 125 261 375 | 838 485 238 | 2 788 348 830 | 892 255 837 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Disruptive Technology | Ecosystem Restoration | Emerging Bond | Emerging Bond Opportunities |
|--|---------------------|--------------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------------|
| | Exprimé en Notes | EUR | EUR | USD | USD |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 3 963 017 638 | 83 750 186 | 432 619 548 | 296 662 016 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 2 713 053 557 | 87 705 283 | 532 308 559 | 322 490 665 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | 1 204 997 275 | (5 508 986) | (121 253 874) | (51 114 577) |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 3 918 050 832 | 82 196 297 | 411 054 685 | 271 376 088 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 7 738 828 | 1 241 751 | 0 | 0 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 25 210 139 | 9 120 | 15 013 154 | 12 418 505 |
| Autres actifs | | 12 017 839 | 303 018 | 6 551 709 | 12 867 423 |
| Passif | | 11 884 403 | 69 184 | 10 916 481 | 8 630 165 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 0 | 69 570 | 404 201 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 0 | 0 | 10 167 928 | 6 922 829 |
| Autres passifs | | 11 884 403 | 69 184 | 678 983 | 1 303 135 |
| Valeur nette d'inventaire | | 3 951 133 235 | 83 681 002 | 421 703 067 | 288 031 851 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 13 955 288 | 524 679 | 27 243 526 | 18 562 238 |
| Commissions de gestion | 3 | 41 731 643 | 195 436 | 2 604 119 | 3 514 255 |
| Intérêts bancaires | | 65 613 | 37 674 | 67 394 | 138 484 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 0 | 2 602 851 | 1 889 693 |
| Autres frais | 6 | 11 513 358 | 134 130 | 839 464 | 770 028 |
| Taxes | 7 | 1 989 108 | 12 499 | 99 929 | 183 046 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 556 831 | 644 825 | 1 772 | 8 086 |
| Commissions de distribution | 4 | 914 838 | 4 487 | 17 702 | 6 572 |
| Total des charges | | 56 771 391 | 1 029 051 | 6 233 231 | 6 510 164 |
| Résultat net des investissements | | (42 816 103) | (504 372) | 21 010 295 | 12 052 074 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | 182 553 154 | (63 211 657) | (59 340 494) | (24 137 032) |
| Instruments financiers | 2 | (2 528 896) | 6 461 798 | 4 752 875 | 595 119 |
| Résultat net réalisé | | 137 208 155 | (57 254 231) | (33 577 324) | (11 489 839) |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 906 679 488 | 64 554 977 | 83 681 902 | 38 894 315 |
| Instruments financiers | | 5 009 129 | (5 907 079) | (2 901 053) | 835 774 |
| Résultat des opérations | | 1 048 896 772 | 1 393 667 | 47 203 525 | 28 240 250 |
| Emissions/(rachats) nets | | 85 449 407 | (48 701 944) | (70 257 031) | (33 409 493) |
| Dividendes distribués | 8 | (4 602 609) | (60 890) | (3 408 090) | (14 604 077) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | 1 129 743 570 | (47 369 167) | (26 461 596) | (19 773 320) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 2 821 389 665 | 131 050 169 | 448 164 663 | 307 805 171 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 3 951 133 235 | 83 681 002 | 421 703 067 | 288 031 851 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Emerging Equity | Emerging Markets Climate Solutions | Energy Transition | Enhanced Bond 6M | Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Euro Bond |
|---------------------|---------------------------------------|----------------------|----------------------|--|----------------------|
| USD | USD | EUR | EUR | USD | EUR |
| 182 655 483 | 122 773 852 | 1 452 923 197 | 2 298 057 087 | 25 630 902 | 430 830 776 |
| 155 236 687 | 125 350 373 | 1 927 419 873 | 2 314 646 238 | 29 009 206 | 451 606 009 |
| 21 863 741 | (2 909 014) | (521 196 189) | (72 804 185) | (7 678 153) | (26 816 990) |
| 177 100 428 | 122 441 359 | 1 406 223 684 | 2 241 842 053 | 21 331 053 | 424 789 019 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 26 353 216 | 0 | 0 | 116 770 |
| 4 786 104 | 136 385 | 10 240 066 | 25 060 300 | 3 546 161 | 1 839 517 |
| 768 951 | 196 108 | 10 106 231 | 31 154 734 | 753 688 | 4 085 470 |
| 779 398 | 32 958 | 7 253 534 | 12 972 401 | 573 002 | 449 675 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 446 005 | 38 177 |
| 0 | 0 | 0 | 9 808 931 | 74 556 | 0 |
| 779 398 | 32 958 | 7 253 534 | 3 163 470 | 52 441 | 411 498 |
| 181 876 085 | 122 740 894 | 1 445 669 663 | 2 285 084 686 | 25 057 900 | 430 381 101 |
| 4 161 499 | 1 766 929 | 9 418 262 | 53 623 614 | 3 074 464 | 6 235 571 |
| 2 867 196 | 382 | 22 606 099 | 3 144 712 | 465 010 | 1 881 296 |
| 1 759 | 17 433 | 771 760 | 49 573 | 35 605 | 516 |
| 0 | 0 | 0 | 5 060 106 | 2 277 364 | 0 |
| 718 187 | 202 772 | 6 418 105 | 1 888 166 | 813 666 | 996 449 |
| 126 320 | 11 019 | 1 156 061 | 441 301 | 21 214 | 162 218 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 470 916 | 435 298 | 4 843 792 | 56 612 | 156 861 | 6 624 |
| 28 621 | 7 | 873 541 | 13 197 | 5 589 | 11 370 |
| 4 212 999 | 666 911 | 36 669 358 | 10 653 667 | 3 775 309 | 3 058 473 |
| (51 500) | 1 100 018 | (27 251 096) | 42 969 947 | (700 845) | 3 177 098 |
| (18 976 088) | (7 587 041) | (837 644 170) | (61 703 725) | (12 575 170) | (28 331 541) |
| 111 271 | 90 366 | 88 881 484 | 15 149 326 | 648 710 | (1 764 650) |
| (18 916 317) | (6 396 657) | (776 013 782) | (3 584 452) | (12 627 305) | (26 919 093) |
| 31 015 290 | 5 514 916 | 376 260 630 | 143 615 958 | 14 500 385 | 54 783 905 |
| 0 | 0 | (88 230 891) | (19 248 072) | (1 109 844) | 2 983 790 |
| 12 098 973 | (881 741) | (487 984 043) | 120 783 434 | 763 236 | 30 848 602 |
| (59 965 422) | 37 501 535 | (16 203 255) | (994 966 949) | (53 889 535) | (148 620 103) |
| (625 715) | (52) | (2 628 528) | (815 057) | 0 | (1 610 791) |
| (48 492 164) | 36 619 742 | (506 815 826) | (874 998 572) | (53 126 299) | (119 382 292) |
| 230 368 249 | 86 121 152 | 1 952 485 489 | 3 160 083 258 | 78 184 199 | 549 763 393 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 181 876 085 | 122 740 894 | 1 445 669 663 | 2 285 084 686 | 25 057 900 | 430 381 101 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Euro Bond Opportunities | Euro Corporate Bond | Euro Corporate Bond Opportunities | Euro Corporate Green Bond |
|--|-----------------------------|----------------------------|------------------------|--------------------------------------|------------------------------|
| | <i>Exprimé en Notes</i> | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 183 133 368 | 1 078 560 511 | 102 825 587 | 101 591 673 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 188 158 268 | 997 940 239 | 99 864 694 | 92 942 217 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | (21 560 891) | 34 690 215 | 552 221 | 6 302 678 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 166 597 377 | 1 032 630 454 | 100 416 915 | 99 244 895 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 736 211 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 387 124 | 0 | 0 | 286 979 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 11 985 208 | 5 894 479 | 784 720 | 588 070 |
| Autres actifs | | 3 427 448 | 40 035 578 | 1 623 952 | 1 471 729 |
| Passif | | 2 618 037 | 4 366 123 | 330 355 | 484 558 |
| Dettes bancaires à vue | | 589 654 | 0 | 0 | 201 332 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 0 | 127 479 | 53 769 | 0 |
| Autres passifs | | 2 028 383 | 4 238 644 | 276 586 | 283 226 |
| Valeur nette d'inventaire | | 180 515 331 | 1 074 194 388 | 102 495 232 | 101 107 115 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 7 209 975 | 35 242 969 | 3 792 352 | 3 059 448 |
| Commissions de gestion | 3 | 1 101 351 | 2 912 926 | 842 254 | 8 856 |
| Intérêts bancaires | | 513 197 | 1 541 | 13 320 | 13 439 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 2 838 188 | 0 | 356 451 | 616 027 |
| Autres frais | 6 | 466 251 | 2 189 758 | 364 832 | 220 309 |
| Taxes | 7 | 103 275 | 280 504 | 81 167 | 12 752 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 32 325 | 27 958 | 6 102 | 526 |
| Commissions de distribution | 4 | 13 093 | 18 432 | 108 984 | 4 |
| Total des charges | | 5 067 680 | 5 431 119 | 1 773 110 | 871 913 |
| Résultat net des investissements | | 2 142 295 | 29 811 850 | 2 019 242 | 2 187 535 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (8 267 405) | (45 457 653) | (18 641 746) | 1 436 615 |
| Instruments financiers | 2 | 4 168 037 | (1 525 449) | (1 017 480) | (231 995) |
| Résultat net réalisé | | (1 957 073) | (17 171 252) | (17 639 984) | 3 392 155 |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 13 973 269 | 115 878 918 | 26 442 656 | 4 908 895 |
| Instruments financiers | | 1 221 231 | (1 504 088) | (203 804) | 286 979 |
| Résultat des opérations | | 13 237 427 | 97 203 578 | 8 598 868 | 8 588 029 |
| Emissions/(rachats) nets | | (14 648 433) | (308 372 913) | (66 624 338) | (38 379 938) |
| Dividendes distribués | 8 | (1 229 221) | (13 642 361) | (346 663) | 0 |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (2 640 227) | (224 811 696) | (58 372 133) | (29 791 909) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 183 155 558 | 1 299 006 084 | 160 867 365 | 130 899 024 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 180 515 331 | 1 074 194 388 | 102 495 232 | 101 107 115 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Euro Defensive Equity | Euro Equity | Euro Flexible Bond | Euro Government Bond | Euro High Quality Government Bond | Euro High Yield Bond |
|--------------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|--------------------------------------|-------------------------|
| EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| 216 162 882 | 1 449 338 431 | 313 088 234 | 1 839 054 265 | 0 | 565 712 473 |
| 186 664 648 | 1 155 226 094 | 290 082 189 | 1 796 714 982 | 0 | 536 435 552 |
| 16 241 528 | 283 587 819 | 4 570 815 | (6 163 849) | 0 | 16 181 752 |
| 202 906 176 | 1 438 813 913 | 294 653 004 | 1 790 551 133 | 0 | 552 617 304 |
| 1 004 800 | 0 | 0 | 0 | 0 | 2 032 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 263 613 |
| 12 117 885 | 9 029 625 | 15 704 524 | 19 275 566 | 0 | 1 685 776 |
| 134 021 | 1 494 893 | 2 730 706 | 29 227 566 | 0 | 11 143 748 |
| 216 065 | 7 460 691 | 8 015 878 | 11 299 212 | 0 | 2 461 526 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 74 488 | 69 119 | 7 213 407 | 747 956 | 0 | 0 |
| 141 577 | 7 391 572 | 802 471 | 10 551 256 | 0 | 2 461 526 |
| 215 946 817 | 1 441 877 740 | 305 072 356 | 1 827 755 053 | 0 | 563 250 947 |
| 6 093 621 | 40 967 404 | 9 748 672 | 22 524 585 | 659 319 | 26 042 437 |
| 730 018 | 17 785 265 | 1 844 998 | 3 488 922 | 21 645 | 3 189 415 |
| 30 859 | 3 182 | 13 685 | 39 055 | 359 | 40 592 |
| 0 | 0 | 3 007 808 | 64 470 | 0 | 626 639 |
| 387 035 | 5 011 450 | 703 866 | 2 668 598 | 122 856 | 1 088 268 |
| 27 596 | 822 454 | 173 347 | 239 385 | 6 732 | 166 394 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 551 052 | 1 188 741 | 99 221 | 77 329 | 2 177 | 10 267 |
| 0 | 331 939 | 9 751 | 25 982 | 0 | 119 265 |
| 1 726 560 | 25 143 031 | 5 852 676 | 6 603 741 | 153 769 | 5 240 840 |
| 4 367 061 | 15 824 373 | 3 895 996 | 15 920 844 | 505 550 | 20 801 597 |
| 7 334 147 | 87 583 013 | (20 027 035) | (59 958 452) | (30 074 202) | (31 580 026) |
| (3 246 935) | 154 225 | 8 062 552 | 3 617 044 | (813 555) | (2 233 596) |
| 8 454 273 | 103 561 611 | (8 068 487) | (40 420 564) | (30 382 207) | (13 012 025) |
| 14 287 267 | 94 476 661 | 25 884 570 | 150 899 913 | 33 222 595 | 78 158 099 |
| (73 923) | (108 988) | (13 385 757) | (7 668 679) | (5 645) | (2 254 807) |
| 22 667 617 | 197 929 284 | 4 430 326 | 102 810 670 | 2 834 743 | 62 891 267 |
| 74 957 867 | (107 462 996) | (132 724 375) | 426 933 615 | (197 566 384) | (60 728 179) |
| (622 320) | (2 325 343) | 0 | (457 700) | (197 297) | (5 419 453) |
| 97 003 164 | 88 140 945 | (128 294 049) | 529 286 585 | (194 928 938) | (3 256 365) |
| 118 943 653 | 1 353 736 795 | 433 366 405 | 1 298 468 468 | 194 928 938 | 566 507 312 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 215 946 817 | 1 441 877 740 | 305 072 356 | 1 827 755 053 | 0 | 563 250 947 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Euro High Yield Short Duration Bond | Euro Inflation- Linked Bond | Euro Medium Term Bond | Euro Money Market |
|--|---------------------|--|--------------------------------|--------------------------|----------------------|
| | Exprimé en Notes | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 324 018 960 | 187 508 678 | 260 736 403 | 2 218 086 820 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 310 625 727 | 179 387 292 | 259 028 101 | 1 952 840 235 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | 3 843 563 | 2 894 684 | (3 619 062) | 20 767 879 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 314 469 290 | 182 281 976 | 255 409 039 | 1 973 608 114 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 0 | 444 414 | 541 965 | 0 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 4 510 145 | 2 713 859 | 22 018 | 166 471 441 |
| Autres actifs | | 5 039 525 | 2 068 429 | 4 763 381 | 78 007 265 |
| Passif | | 2 405 723 | 1 974 169 | 696 164 | 50 681 098 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 135 320 | 79 312 | 0 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 11 859 | 0 | 0 | 857 008 |
| Autres passifs | | 2 393 864 | 1 838 849 | 616 852 | 49 824 090 |
| Valeur nette d'inventaire | | 321 613 237 | 185 534 509 | 260 040 239 | 2 167 405 722 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 14 240 190 | 2 014 635 | 3 945 469 | 52 653 823 |
| Commissions de gestion | 3 | 1 360 971 | 670 983 | 922 626 | 4 571 364 |
| Intérêts bancaires | | 19 076 | 36 236 | 5 938 | 57 800 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 784 278 | 50 342 | 0 | 29 204 601 |
| Autres frais | 6 | 665 630 | 398 210 | 618 962 | 2 138 470 |
| Taxes | 7 | 125 868 | 63 887 | 157 731 | 287 576 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 0 | 11 302 | 7 111 | 0 |
| Commissions de distribution | 4 | 13 751 | 50 615 | 13 044 | 0 |
| Total des charges | | 2 969 574 | 1 281 575 | 1 725 412 | 36 259 811 |
| Résultat net des investissements | | 11 270 616 | 733 060 | 2 220 057 | 16 394 012 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (4 044 250) | (7 124 306) | (6 737 957) | 22 190 313 |
| Instruments financiers | 2 | 242 869 | (1 999 299) | (351 091) | (16 661) |
| Résultat net réalisé | | 7 469 235 | (8 390 545) | (4 868 991) | 38 567 664 |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 20 940 376 | 18 167 297 | 16 625 833 | 20 544 736 |
| Instruments financiers | | (2 143 411) | 1 137 533 | 1 794 715 | (3 310 896) |
| Résultat des opérations | | 26 266 200 | 10 914 285 | 13 551 557 | 55 801 504 |
| Emissions/(rachats) nets | | 35 565 171 | (55 692 423) | 19 594 474 | 762 674 301 |
| Dividendes distribués | 8 | (636 207) | (424 475) | (1 206 029) | 0 |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | 61 195 164 | (45 202 613) | 31 940 002 | 818 475 805 |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 260 418 073 | 230 737 122 | 228 100 237 | 1 348 929 917 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 321 613 237 | 185 534 509 | 260 040 239 | 2 167 405 722 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | Europe Convertible | Europe Emerging Equity | Europe Equity | Europe Growth | Europe High Conviction Bond |
|--|---------------------|---------------------------|----------------------|--------------------|--------------------------------|
| EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| 375 676 262 | 62 925 886 | 0 | 902 217 546 | 120 965 331 | 309 518 167 |
| 373 037 860 | 62 701 881 | 0 | 715 386 540 | 95 116 114 | 323 876 869 |
| (8 011 022) | (760 277) | 0 | 184 001 967 | 24 846 836 | (22 004 623) |
| 365 026 838 | 61 941 604 | 0 | 899 388 507 | 119 962 950 | 301 872 246 |
| 0 | 5 163 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 144 146 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 4 524 540 | 659 338 | 0 | 8 051 | 742 046 | 623 996 |
| 6 124 884 | 175 635 | 0 | 2 820 988 | 260 335 | 7 021 925 |
| 1 721 629 | 213 878 | 0 | 2 904 442 | 730 946 | 314 266 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1 046 616 | 0 | 0 | 0 | 10 415 | 0 |
| 675 013 | 213 878 | 0 | 2 904 442 | 720 531 | 314 266 |
| 373 954 633 | 62 712 008 | 0 | 899 313 104 | 120 234 385 | 309 203 901 |
| 10 987 961 | 557 047 | 438 440 | 24 911 769 | 2 155 341 | 11 504 411 |
| 2 465 674 | 780 477 | 0 | 9 385 331 | 1 133 414 | 586 250 |
| 219 521 | 3 114 | 10 | 2 782 | 389 | 461 |
| 1 485 965 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 973 351 | 232 906 | 37 038 | 3 199 058 | 424 362 | 448 878 |
| 186 450 | 44 571 | 7 761 | 454 853 | 70 392 | 132 253 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 31 817 | 4 870 | 21 440 | 535 384 | 104 943 | 0 |
| 304 798 | 8 072 | 0 | 51 801 | 3 864 | 0 |
| 5 667 576 | 1 074 010 | 66 249 | 13 629 209 | 1 737 364 | 1 167 842 |
| 5 320 385 | (516 963) | 372 191 | 11 282 560 | 417 977 | 10 336 569 |
| (38 761 549) | 1 129 357 | (20 810 291) | 80 102 119 | 2 950 957 | (20 959 285) |
| 1 772 195 | 777 334 | (158 668) | (12 607) | (35 270) | (2 172) |
| (31 668 969) | 1 389 728 | (20 596 768) | 91 372 072 | 3 333 664 | (10 624 888) |
| 59 891 442 | 3 106 193 | 23 314 361 | 35 041 872 | 9 907 659 | 48 421 805 |
| (9 276 634) | (999 038) | 0 | 0 | 23 528 | 0 |
| 18 945 839 | 3 496 883 | 2 717 593 | 126 413 944 | 13 264 851 | 37 796 917 |
| (95 251 042) | (14 306 130) | (22 605 729) | (282 494 845) | (7 852 446) | (10 724 221) |
| (990 984) | (270 392) | 0 | (3 378 586) | (2 105 599) | (31 662) |
| (77 296 187) | (11 079 639) | (19 888 136) | (159 459 487) | 3 306 806 | 27 041 034 |
| 451 250 820 | 73 791 647 | 19 888 136 | 1 058 772 591 | 116 927 579 | 282 162 867 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 373 954 633 | 62 712 008 | 0 | 899 313 104 | 120 234 385 | 309 203 901 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Europe Real Estate Securities | Europe Small Cap | Europe Small Cap Convertible | Flexible Global Credit |
|---|------------------|-------------------------------|----------------------|------------------------------|------------------------|
| | Exprimé en Notes | EUR | EUR | EUR | EUR |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 111 795 453 | 459 799 307 | 207 165 213 | 15 017 649 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 116 044 345 | 422 014 810 | 224 544 939 | 14 273 538 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | (7 165 957) | 36 107 523 | (20 433 223) | (306 409) |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 108 878 388 | 458 122 333 | 204 111 716 | 13 967 129 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 0 | 0 | 37 684 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 1 975 721 | 988 805 | 2 071 957 | 889 863 |
| Autres actifs | | 941 344 | 688 169 | 981 540 | 122 973 |
| Passif | | 1 848 055 | 1 719 604 | 585 512 | 75 115 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 0 | 0 | 50 859 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 34 660 | 0 | 0 |
| Autres passifs | | 1 848 055 | 1 684 944 | 585 512 | 24 256 |
| Valeur nette d'inventaire | | 109 947 398 | 458 079 703 | 206 579 701 | 14 942 534 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 4 888 358 | 11 951 249 | 4 237 655 | 569 503 |
| Commissions de gestion | 3 | 896 268 | 6 631 847 | 2 566 788 | 12 820 |
| Intérêts bancaires | | 86 | 3 483 | 2 906 | 68 444 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 0 | 0 | 46 134 |
| Autres frais | 6 | 347 226 | 1 581 827 | 782 755 | 33 401 |
| Taxes | 7 | 41 730 | 253 181 | 136 948 | 3 358 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 89 163 | 797 422 | 842 | 4 204 |
| Commissions de distribution | 4 | 5 857 | 58 406 | 53 659 | 0 |
| Total des charges | | 1 380 330 | 9 326 166 | 3 543 898 | 168 361 |
| Résultat net des investissements | | 3 508 028 | 2 625 083 | 693 757 | 401 142 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (28 352 205) | (6 584 329) | (2 864 532) | (394 620) |
| Instruments financiers | 2 | (33 586) | (23 179) | (14 554) | 296 318 |
| Résultat net réalisé | | (24 877 763) | (3 982 425) | (2 185 329) | 302 840 |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 37 754 346 | 49 669 668 | 13 231 134 | 562 617 |
| Instruments financiers | | 0 | 53 983 | 0 | (364 624) |
| Résultat des opérations | | 12 876 583 | 45 741 226 | 11 045 805 | 500 833 |
| Emissions/(rachats) nets | | (99 840 668) | (172 943 717) | (82 258 159) | (7 898 143) |
| Dividendes distribués | 8 | (1 558 266) | (1 747 229) | (2 112 349) | (377 413) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (88 522 351) | (128 949 720) | (73 324 703) | (7 774 723) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 198 469 749 | 587 029 423 | 279 904 404 | 22 717 257 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 109 947 398 | 458 079 703 | 206 579 701 | 14 942 534 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Global Absolute Return Multi-Factor Bond | Global Bond Opportunities | Global Climate Solutions | Global Convertible | Global Enhanced Bond 36M | Global Environment |
|--|------------------------------|-----------------------------|----------------------|-----------------------------|----------------------|
| EUR | EUR | EUR | USD | EUR | EUR |
| 5 836 875 | 390 802 123 | 138 227 784 | 557 114 891 | 199 126 853 | 2 268 682 860 |
| 5 333 183 | 353 161 889 | 136 396 013 | 580 787 131 | 155 546 656 | 1 854 060 504 |
| 61 916 | (21 650 136) | (353 441) | (47 913 022) | (1 013 195) | 352 986 548 |
| 5 395 099 | 331 511 753 | 136 042 572 | 532 874 109 | 154 533 461 | 2 207 047 052 |
| 0 | 1 703 264 | 0 | 70 000 | 812 511 | 0 |
| 7 969 | 6 085 379 | 0 | 373 366 | 0 | 3 589 878 |
| 391 041 | 32 104 792 | 2 014 760 | 10 109 500 | 19 277 142 | 48 474 223 |
| 42 766 | 19 396 935 | 170 452 | 13 687 916 | 24 503 739 | 9 571 707 |
| 145 440 | 30 793 638 | 27 324 | 2 468 020 | 38 240 477 | 17 370 547 |
| 132 509 | 2 217 115 | 0 | 1 | 192 207 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 443 832 | 0 |
| 12 931 | 28 576 523 | 27 324 | 2 468 019 | 37 604 438 | 17 370 547 |
| 5 691 435 | 360 008 485 | 138 200 460 | 554 646 871 | 160 886 376 | 2 251 312 313 |
| 168 588 | 19 709 881 | 996 200 | 5 712 573 | 7 625 613 | 38 216 103 |
| 8 876 | 2 178 128 | 7 006 | 5 789 143 | 221 307 | 28 933 584 |
| 12 750 | 200 898 | 26 393 | 293 734 | 145 218 | 62 093 |
| 95 736 | 7 988 061 | 0 | 165 632 | 2 735 448 | 0 |
| 6 565 | 971 899 | 127 843 | 1 829 271 | 174 910 | 7 790 763 |
| 562 | 189 103 | 8 424 | 268 200 | 28 881 | 987 734 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 57 736 | 0 |
| 164 | 101 893 | 172 712 | 20 098 | 40 894 | 2 703 096 |
| 0 | 126 241 | 7 | 67 149 | 1 264 | 593 632 |
| 124 653 | 11 756 223 | 342 385 | 8 433 227 | 3 405 658 | 41 070 902 |
| 43 935 | 7 953 658 | 653 815 | (2 720 654) | 4 219 955 | (2 854 799) |
| 72 483 | (27 785 408) | (2 322 744) | (29 993 172) | (2 305 301) | 193 362 185 |
| 106 101 | 17 769 809 | 183 444 | 17 838 404 | 3 588 941 | (39 126 362) |
| 222 519 | (2 061 941) | (1 485 485) | (14 875 422) | 5 503 595 | 151 381 024 |
| 58 003 | 23 204 724 | 1 450 780 | 76 976 798 | 2 547 135 | 100 583 876 |
| (68 170) | (4 771 608) | 0 | (10 172 969) | (1 902 544) | (10 519 465) |
| 212 352 | 16 371 175 | (34 705) | 51 928 407 | 6 148 186 | 241 445 435 |
| 0 | (32 433 608) | 109 910 020 | (256 130 016) | 103 815 353 | (921 854 190) |
| 0 | (3 185 796) | 0 | (3 702 693) | (19 523) | (4 812 696) |
| 212 352 | (19 248 229) | 109 875 315 | (207 904 302) | 109 944 016 | (685 221 451) |
| 5 479 083 | 379 256 714 | 28 325 145 | 762 551 173 | 50 942 360 | 2 936 533 764 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 5 691 435 | 360 008 485 | 138 200 460 | 554 646 871 | 160 886 376 | 2 251 312 313 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Global High Yield Bond | Global Inflation-Linked Bond | Green Bond | Green Tigers |
|---|---------------|------------------------|------------------------------|----------------------|----------------------|
| | Exprimé en | EUR | EUR | EUR | USD |
| | Notes | | | | |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 79 321 423 | 521 107 117 | 1 411 684 811 | 899 453 456 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 74 425 796 | 512 835 161 | 1 469 507 830 | 1 043 938 971 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | 965 493 | (11 147 494) | (80 069 493) | (165 487 814) |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 75 391 289 | 501 687 667 | 1 389 438 337 | 878 451 157 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 1 893 426 | 6 057 215 | 6 560 902 | 359 890 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 517 042 | 9 746 632 | 1 856 260 | 17 181 096 |
| Autres actifs | | 1 519 666 | 3 615 603 | 13 829 312 | 3 461 313 |
| Passif | | 310 534 | 13 287 650 | 4 222 061 | 16 673 830 |
| Dettes bancaires à vue | | 97 133 | 7 450 000 | 0 | 0 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Autres passifs | | 213 401 | 5 837 650 | 4 222 061 | 16 673 830 |
| Valeur nette d'inventaire | | 79 010 889 | 507 819 467 | 1 407 462 750 | 882 779 626 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 4 800 621 | 4 420 485 | 28 064 114 | 21 060 442 |
| Commissions de gestion | 3 | 760 179 | 863 141 | 1 952 364 | 13 616 131 |
| Intérêts bancaires | | 16 317 | 326 867 | 77 243 | 3 615 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 198 395 | 0 | 0 |
| Autres frais | 6 | 212 637 | 741 652 | 2 455 645 | 3 714 844 |
| Taxes | 7 | 48 004 | 95 164 | 287 218 | 4 139 981 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 157 | 0 | 11 154 | 1 978 953 |
| Commissions de distribution | 4 | 78 879 | 36 482 | 203 549 | 31 630 |
| Total des charges | | 1 116 173 | 2 261 701 | 4 987 173 | 23 485 154 |
| Résultat net des investissements | | 3 684 448 | 2 158 784 | 23 076 941 | (2 424 712) |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (4 152 733) | (43 002 312) | (40 793 779) | (99 916 673) |
| Instruments financiers | 2 | 2 418 612 | 2 008 093 | 11 182 338 | (4 092) |
| Résultat net réalisé | | 1 950 327 | (38 835 435) | (6 534 500) | (102 345 477) |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 7 908 678 | 48 073 240 | 111 913 849 | 77 781 151 |
| Instruments financiers | | (2 219 228) | (8 410 745) | (13 448 877) | 314 114 |
| Résultat des opérations | | 7 639 777 | 827 060 | 91 930 472 | (24 250 212) |
| Emissions/(rachats) nets | | (9 742 640) | 82 764 079 | 11 136 287 | (347 930 857) |
| Dividendes distribués | 8 | (2 083 170) | (183 514) | (18 338 766) | (2 651 684) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (4 186 033) | 83 407 625 | 84 727 993 | (374 832 753) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 83 196 922 | 424 411 842 | 1 322 734 757 | 1 257 612 379 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 79 010 889 | 507 819 467 | 1 407 462 750 | 882 779 626 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Harmony | Health Care Innovators | Inclusive Growth | India Equity | Japan Equity | Japan Small Cap |
|----------------------|------------------------|--------------------|---------------------|-----------------------|-------------------------|
| EUR | EUR | EUR | USD | JPY | JPY |
| 0 | 1 482 710 730 | 553 931 246 | 230 693 565 | 27 506 289 743 | 98 843 580 592 |
| 0 | 1 270 225 730 | 481 476 653 | 164 292 483 | 22 467 260 747 | 71 628 643 687 |
| 0 | 188 368 824 | 68 628 067 | 46 413 885 | 3 804 061 516 | 20 234 232 622 |
| 0 | 1 458 594 554 | 550 104 720 | 210 706 368 | 26 271 322 263 | 91 862 876 309 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 1 810 029 | 241 369 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 16 662 745 | 2 788 579 | 17 076 392 | 1 123 278 121 | 6 476 490 776 |
| 0 | 5 643 402 | 796 578 | 2 910 805 | 111 689 359 | 504 213 507 |
| 0 | 9 465 456 | 1 936 605 | 10 022 068 | 573 056 805 | 993 593 580 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 441 033 185 | 582 178 269 |
| 0 | 9 465 456 | 1 936 605 | 10 022 068 | 132 023 620 | 411 415 311 |
| 0 | 1 473 245 274 | 551 994 641 | 220 671 497 | 26 933 232 938 | 97 849 987 012 |
| 192 041 | 11 392 706 | 6 130 058 | 2 264 809 | 464 906 861 | 1 918 894 904 |
| 305 874 | 20 870 043 | 4 480 310 | 2 742 112 | 298 530 258 | 1 068 136 451 |
| 1 536 | 15 348 | 994 | 9 069 | 7 201 406 | 24 559 301 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 103 934 | 5 615 582 | 1 416 872 | 632 176 | 82 426 911 | 230 390 829 |
| 122 063 | 1 000 240 | 212 652 | 6 710 326 | 14 610 809 | 31 449 243 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 59 971 | 870 545 | 230 684 | 588 619 | 28 992 695 | 88 539 363 |
| 42 942 | 450 786 | 9 886 | 73 138 | 2 134 638 | 1 922 997 |
| 636 320 | 28 822 544 | 6 351 398 | 10 755 440 | 433 896 717 | 1 444 998 184 |
| (444 279) | (17 429 838) | (221 340) | (8 490 631) | 31 010 144 | 473 896 720 |
| (5 195 589) | 49 560 007 | 3 251 833 | 14 364 962 | 2 664 886 312 | 9 703 672 419 |
| 313 188 | (829 226) | 191 431 | (73 283) | 1 610 756 446 | 2 056 536 233 |
| (5 326 680) | 31 300 943 | 3 221 924 | 5 801 048 | 4 306 652 902 | 12 234 105 372 |
| 7 736 901 | (28 769 397) | 57 397 803 | 32 572 151 | 2 864 932 417 | 9 063 656 284 |
| (421 094) | 1 004 902 | 115 231 | 0 | (306 551 785) | (246 870 429) |
| 1 989 127 | 3 536 448 | 60 734 958 | 38 373 199 | 6 865 033 534 | 21 050 891 227 |
| (119 037 103) | (81 629 572) | 126 111 652 | (37 278 478) | (3 663 678) | (13 294 938 350) |
| 0 | (1 972 797) | (223 631) | (117 385) | (18 702 461) | (9 826 867) |
| (117 047 976) | (80 065 921) | 186 622 979 | 977 336 | 6 842 667 395 | 7 746 126 010 |
| 117 047 976 | 1 553 311 195 | 365 371 662 | 219 694 161 | 20 090 565 543 | 90 103 861 002 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 1 473 245 274 | 551 994 641 | 220 671 497 | 26 933 232 938 | 97 849 987 012 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Latin America Equity | Local Emerging Bond | Multi-Asset Opportunities | Multi-Asset Thematic |
|--|---------------------|-------------------------|------------------------|------------------------------|----------------------|
| | Exprimé en Notes | USD | USD | USD | EUR |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 48 750 987 | 210 229 238 | 13 813 578 | 160 642 371 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 39 093 178 | 191 064 982 | 15 014 343 | 159 967 740 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | 8 804 812 | 2 426 433 | (2 348 879) | (1 308 587) |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 47 897 990 | 193 491 415 | 12 665 464 | 158 659 153 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 79 643 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 0 | 1 200 819 | 112 226 | 351 700 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 307 609 | 11 967 958 | 1 014 177 | 1 509 139 |
| Autres actifs | | 545 388 | 3 569 046 | 21 711 | 42 736 |
| Passif | | 361 344 | 704 212 | 1 679 108 | 571 799 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 54 899 | 14 625 | 0 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13, 14 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Autres passifs | | 361 344 | 649 313 | 1 664 483 | 571 799 |
| Valeur nette d'inventaire | | 48 389 643 | 209 525 026 | 12 134 470 | 160 070 572 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 2 007 650 | 12 316 817 | 522 876 | 2 037 852 |
| Commissions de gestion | 3 | 727 495 | 1 796 504 | 175 775 | 2 290 074 |
| Intérêts bancaires | | 1 066 | 197 041 | 11 239 | 27 909 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 892 804 | 0 | 0 |
| Autres frais | 6 | 181 644 | 448 038 | 50 673 | 645 642 |
| Taxes | 7 | 33 287 | 60 600 | 12 588 | 57 121 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 147 016 | 0 | 27 911 | 50 495 |
| Commissions de distribution | 4 | 9 848 | 34 846 | 46 | 7 965 |
| Total des charges | | 1 100 356 | 3 429 833 | 278 232 | 3 079 206 |
| Résultat net des investissements | | 907 294 | 8 886 984 | 244 644 | (1 041 354) |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (175 734) | (4 661 430) | (4 211 780) | (11 538 014) |
| Instruments financiers | 2 | (23 956) | 4 549 605 | 425 723 | (3 115 860) |
| Résultat net réalisé | | 707 604 | 8 775 159 | (3 541 413) | (15 695 228) |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 9 476 330 | 19 713 312 | 4 469 787 | 19 647 066 |
| Instruments financiers | | 0 | (1 892 360) | (384 253) | 1 168 943 |
| Résultat des opérations | | 10 183 934 | 26 596 111 | 544 121 | 5 120 781 |
| Emissions/(rachats) nets | | (5 418 539) | (41 647 738) | (10 926 982) | (67 336 792) |
| Dividendes distribués | 8 | (222 348) | (3 578 208) | (342 641) | (1 179 578) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | 4 543 047 | (18 629 835) | (10 725 502) | (63 395 589) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 43 846 596 | 228 154 861 | 22 859 972 | 223 466 161 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 48 389 643 | 209 525 026 | 12 134 470 | 160 070 572 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Nordic Small Cap | RMB Bond | Russia Equity (VNI suspendue) | Seasons | SMaRT Food | Social Bond |
|---------------------|----------------------|-------------------------------|---------------------|----------------------|---------------------|
| EUR | USD | EUR | EUR | EUR | EUR |
| 135 903 788 | 183 637 373 | 59 089 289 | 579 983 196 | 1 098 130 739 | 198 831 841 |
| 121 535 329 | 180 564 103 | 556 314 810 | 391 781 154 | 1 115 291 664 | 198 739 679 |
| 10 573 494 | (567 803) | (500 154 812) | 58 831 714 | (34 587 071) | (6 370 163) |
| 132 108 823 | 179 996 300 | 56 159 998 | 450 612 868 | 1 080 704 593 | 192 369 516 |
| 0 | 0 | 0 | 87 018 400 | 0 | 0 |
| 1 050 433 | 0 | 25 047 | 0 | 542 495 | 27 156 |
| 2 414 155 | 654 656 | 2 875 049 | 41 915 620 | 14 882 416 | 4 787 386 |
| 330 377 | 2 986 417 | 29 195 | 436 308 | 2 001 235 | 1 647 783 |
| 667 629 | 84 058 | 1 129 241 | 41 335 060 | 3 617 796 | 621 306 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 0 | 4 770 | 0 | 39 145 399 | 0 | 0 |
| 667 629 | 79 288 | 1 129 241 | 2 189 661 | 3 617 796 | 621 306 |
| 135 236 159 | 183 553 315 | 57 960 048 | 538 648 136 | 1 094 512 943 | 198 210 535 |
| 4 479 032 | 7 263 364 | 336 829 | 1 046 489 | 27 968 795 | 3 613 790 |
| 2 442 181 | 358 115 | 0 | 5 163 858 | 17 860 495 | 106 727 |
| 4 575 | 32 146 | 26 004 | 21 095 | 33 355 | 3 943 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 567 758 | 421 583 | 190 933 | 621 784 | 4 328 730 | 423 164 |
| 102 566 | 36 099 | 8 962 | 374 700 | 768 685 | 26 729 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 107 940 | 5 000 | 39 | 516 235 | 649 327 | 3 815 |
| 30 062 | 157 | 0 | 1 074 594 | 262 186 | 4 |
| 3 255 082 | 853 100 | 225 938 | 7 772 266 | 23 902 778 | 564 382 |
| 1 223 950 | 6 410 264 | 110 891 | (6 725 777) | 4 066 017 | 3 049 408 |
| (16 739 803) | (9 824 864) | (4 793 812) | 16 106 564 | 28 009 790 | (7 138 084) |
| (3 325 944) | 149 049 | (156 057) | 38 028 425 | 678 421 | 2 637 502 |
| (18 841 797) | (3 265 551) | (4 838 978) | 47 409 212 | 32 754 228 | (1 451 174) |
| 16 415 461 | 7 738 868 | 8 763 154 | 42 406 037 | (96 817 654) | 18 719 642 |
| 866 071 | (33 619) | 82 925 | (2 534 487) | 3 232 006 | (2 720 441) |
| (1 560 265) | 4 439 698 | 4 007 101 | 87 280 762 | (60 831 420) | 14 548 027 |
| (53 161 863) | (114 071 264) | 0 | (37 220 952) | (496 309 790) | (84 842 511) |
| (1 719 556) | (190 979) | 0 | 0 | (1 364 419) | (220 808) |
| (56 441 684) | (109 822 545) | 4 007 101 | 50 059 810 | (558 505 629) | (70 515 292) |
| 191 677 843 | 293 375 860 | 53 952 947 | 488 588 326 | 1 653 018 572 | 268 725 827 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 135 236 159 | 183 553 315 | 57 960 048 | 538 648 136 | 1 094 512 943 | 198 210 535 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Sustainable Asia ex-Japan Equity | Sustainable Asian Cities Bond | Sustainable Enhanced Bond 12M | Sustainable Euro Bond |
|---|------------------|----------------------------------|-------------------------------|-------------------------------|-----------------------|
| | Exprimé en Notes | USD | USD | EUR | EUR |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 286 180 389 | 80 672 755 | 1 882 456 073 | 388 290 124 |
| Portefeuille-titres au coût d'acquisition | | 276 130 532 | 80 546 221 | 1 840 308 474 | 406 525 236 |
| Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres | | (4 110 166) | (871 808) | (34 348 290) | (28 495 387) |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 272 020 366 | 79 674 413 | 1 805 960 184 | 378 029 849 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 9 944 | 44 087 | 0 | 17 130 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 12 380 898 | 75 068 | 52 561 626 | 6 082 901 |
| Autres actifs | | 1 769 181 | 879 187 | 23 934 263 | 4 160 244 |
| Passif | | 3 452 858 | 73 206 | 14 501 107 | 12 308 016 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 0 | 6 875 787 | 0 |
| Autres passifs | | 3 452 858 | 73 206 | 7 625 320 | 12 308 016 |
| Valeur nette d'inventaire | | 282 727 531 | 80 599 549 | 1 867 954 966 | 375 982 108 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 7 202 385 | 2 869 008 | 44 720 436 | 7 361 108 |
| Commissions de gestion | 3 | 4 614 751 | 328 811 | 2 078 142 | 1 056 521 |
| Intérêts bancaires | | 9 423 | 3 715 | 1 704 | 80 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 0 | 2 840 344 | 0 |
| Autres frais | 6 | 1 301 120 | 163 076 | 2 804 368 | 889 570 |
| Taxes | 7 | 298 182 | 32 331 | 512 895 | 92 107 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 1 025 576 | 0 | 49 299 | 8 668 |
| Commissions de distribution | 4 | 7 699 | 811 | 62 962 | 16 009 |
| Total des charges | | 7 256 751 | 528 744 | 8 349 714 | 2 062 955 |
| Résultat net des investissements | | (54 366) | 2 340 264 | 36 370 722 | 5 298 153 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (91 741 191) | 36 855 | (65 541 750) | (38 003 230) |
| Instruments financiers | 2 | 60 620 | (42 888) | 15 463 376 | (20 856) |
| Résultat net réalisé | | (91 734 937) | 2 334 231 | (13 707 652) | (32 725 933) |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 93 498 131 | 697 517 | 144 062 664 | 66 176 185 |
| Instruments financiers | | (19 665) | 33 682 | (19 065 563) | (100 562) |
| Résultat des opérations | | 1 743 529 | 3 065 430 | 111 289 449 | 33 349 690 |
| Emissions/(rachats) nets | | (280 266 965) | 31 249 405 | (1 472 874 531) | (201 456 588) |
| Dividendes distribués | 8 | (2 474 108) | (1 039 410) | (24 424 577) | (370 870) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (280 997 544) | 33 275 425 | (1 386 009 659) | (168 477 768) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 563 725 075 | 47 324 124 | 3 253 964 625 | 544 459 876 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 282 727 531 | 80 599 549 | 1 867 954 966 | 375 982 108 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Sustainable Euro Corporate Bond | Sustainable Euro Low Vol Equity | Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond | Sustainable Euro Multi-Factor Equity | Sustainable Europe Dividend | Sustainable Europe Multi-Factor Equity |
|--|---------------------------------------|--|---------------------------------------|---|---|
| EUR | EUR | EUR | EUR | EUR | EUR |
| 1 022 437 847 | 40 933 760 | 256 198 150 | 25 566 675 | 134 954 003 | 326 047 799 |
| 1 032 725 627 (36 080 207) | 37 923 179 2 913 363 | 247 368 025 3 136 112 | 22 467 911 2 198 651 | 108 534 724 26 209 220 | 291 648 002 29 782 654 |
| 996 645 420 0 3 715 021 | 40 836 542 0 0 | 250 504 137 0 962 482 | 24 666 562 0 0 | 134 743 944 0 0 | 321 430 656 0 268 474 |
| 7 351 711 14 725 695 | 77 970 19 248 | 1 842 780 2 888 751 | 318 800 581 313 | 91 299 118 760 | 3 234 282 1 114 387 |
| 8 426 268 | 96 837 | 132 904 | 558 642 | 193 827 | 1 006 569 |
| 914 793 0 | 0 0 | 14 694 0 | 0 14 600 | 0 7 197 | 0 0 |
| 7 511 475 | 96 837 | 118 210 | 544 042 | 186 630 | 1 006 569 |
| 1 014 011 579 | 40 836 923 | 256 065 246 | 25 008 033 | 134 760 176 | 325 041 230 |
| 31 409 770 | 1 742 581 | 5 138 826 | 2 116 670 | 4 414 338 | 11 548 907 |
| 1 770 892 36 690 6 327 761 | 498 343 15 0 | 156 152 32 632 0 | 154 590 8 709 0 | 1 022 735 1 421 0 | 1 531 803 1 392 0 |
| 2 329 581 277 517 0 1 760 25 490 | 170 709 25 847 0 92 900 0 | 488 721 47 596 0 3 680 83 668 | 113 346 5 470 0 130 816 0 | 399 896 56 479 0 139 303 19 936 | 894 037 71 209 0 825 814 95 359 |
| 10 769 691 | 787 814 | 812 449 | 412 931 | 1 639 770 | 3 419 614 |
| 20 640 079 | 954 767 | 4 326 377 | 1 703 739 | 2 774 568 | 8 129 293 |
| (92 009 459) 975 043 | 930 023 (5) | (10 870 542) (503 363) | 6 516 494 481 806 | 4 716 621 3 947 | 26 824 092 2 288 888 |
| (70 394 337) | 1 884 785 | (7 047 528) | 8 702 039 | 7 495 136 | 37 242 273 |
| 160 167 030 77 598 | 6 534 700 0 | 25 949 412 1 173 366 | 649 966 124 070 | 12 491 802 12 514 | 20 293 323 1 067 954 |
| 89 850 291 | 8 419 485 | 20 075 250 | 9 476 075 | 19 999 452 | 58 603 550 |
| (697 830 483) | (31 953 829) | (19 355 524) | (46 408 589) | (20 354 582) | (74 840 856) |
| (11 487 938) | 0 | (93 569) | 0 | (831 475) | (114 219) |
| (619 468 130) | (23 534 344) | 626 157 | (36 932 514) | (1 186 605) | (16 351 525) |
| 1 633 479 709 | 64 371 267 | 255 439 089 | 61 940 547 | 135 946 781 | 341 392 755 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1 014 011 579 | 40 836 923 | 256 065 246 | 25 008 033 | 134 760 176 | 325 041 230 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Sustainable Europe Value | Sustainable Global Corporate Bond | Sustainable Global Equity | Sustainable Global Low Vol Equity |
|---|------------------|--------------------------|-----------------------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| | Exprimé en Notes | EUR | USD | USD | EUR |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 420 801 837 | 389 228 127 | 340 184 570 | 755 303 613 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 374 689 549 | 375 158 276 | 286 372 790 | 707 700 842 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | 45 507 799 | (8 015 128) | 50 924 316 | 42 931 940 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 420 197 348 | 367 143 148 | 337 297 106 | 750 632 782 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 371 294 | 0 | 1 062 026 | 200 974 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 56 640 | 10 777 723 | 1 445 532 | 3 002 478 |
| Autres actifs | | 176 555 | 11 307 256 | 379 906 | 1 467 379 |
| Passif | | 1 826 087 | 8 768 102 | 1 520 597 | 2 529 971 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 48 216 | 0 | 0 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 4 836 415 | 0 | 0 |
| Autres passifs | | 1 826 087 | 3 883 471 | 1 520 597 | 2 529 971 |
| Valeur nette d'inventaire | | 418 975 750 | 380 460 025 | 338 663 973 | 752 773 642 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 23 644 465 | 14 568 962 | 4 729 432 | 18 772 743 |
| Commissions de gestion | 3 | 6 245 073 | 1 553 224 | 4 390 160 | 8 520 318 |
| Intérêts bancaires | | 31 070 | 52 708 | 3 479 | 77 663 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 934 | 0 | 0 |
| Autres frais | 6 | 1 857 758 | 850 738 | 1 250 493 | 2 456 790 |
| Taxes | 7 | 313 535 | 107 811 | 220 384 | 357 061 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 1 029 569 | 18 665 | 231 393 | 688 367 |
| Commissions de distribution | 4 | 7 679 | 286 330 | 166 358 | 343 188 |
| Total des charges | | 9 484 684 | 2 870 410 | 6 262 267 | 12 443 387 |
| Résultat net des investissements | | 14 159 781 | 11 698 552 | (1 532 835) | 6 329 356 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | 29 593 568 | (43 591 743) | 8 279 528 | 1 645 849 |
| Instruments financiers | 2 | 2 003 661 | (7 404 620) | (691 224) | 277 969 |
| Résultat net réalisé | | 45 757 010 | (39 297 811) | 6 055 469 | 8 253 174 |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 20 438 785 | 69 493 942 | 54 178 731 | 59 759 211 |
| Instruments financiers | | 3 165 737 | 5 865 903 | 1 057 977 | 67 916 |
| Résultat des opérations | | 69 361 532 | 36 062 034 | 61 292 177 | 68 080 301 |
| Emissions/(rachats) nets | | (204 483 186) | (104 300 107) | (39 129 323) | (122 052 464) |
| Dividendes distribués | 8 | (200 242) | (7 250 362) | (921 523) | (650 837) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (135 321 896) | (75 488 435) | 21 241 331 | (54 623 000) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 554 297 646 | 455 948 460 | 317 422 642 | 807 396 642 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 418 975 750 | 380 460 025 | 338 663 973 | 752 773 642 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | Sustainable Global Multi-Factor Equity | Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond | Sustainable Japan Multi-Factor Equity | Sustainable Multi-Asset Balanced | Sustainable Multi-Asset Flexible |
|--|--|---|---------------------------------------|----------------------------------|----------------------------------|
| USD | USD | USD | JPY | EUR | EUR |
| 60 430 161 | 30 394 088 | 23 544 497 | 2 723 881 911 | 1 008 415 450 | 94 217 591 |
| 57 535 306 | 27 258 807 | 21 345 772 | 2 229 850 942 | 930 534 386 | 89 412 306 |
| 543 670 | 2 361 263 | 1 060 116 | 442 452 515 | 48 429 326 | 2 997 267 |
| 58 078 976 | 29 620 070 | 22 405 888 | 2 672 303 457 | 978 963 712 | 92 409 573 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 509 |
| 764 908 | 249 732 | 95 557 | 0 | 1 763 056 | 407 785 |
| 911 002 | 464 362 | 733 210 | 39 293 044 | 16 643 388 | 1 399 724 |
| 675 275 | 59 924 | 309 842 | 12 285 410 | 11 045 294 | 0 |
| 789 613 | 338 603 | 101 619 | 21 914 707 | 10 509 940 | 186 181 |
| 221 501 | 179 025 | 97 437 | 0 | 629 009 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 174 000 | 0 | 0 |
| 568 112 | 159 578 | 4 182 | 21 740 707 | 9 880 931 | 186 181 |
| 59 640 548 | 30 055 485 | 23 442 878 | 2 701 967 204 | 997 905 510 | 94 031 410 |
| 2 414 123 | 555 032 | 1 841 738 | 57 837 806 | 8 496 655 | 144 817 |
| 18 245 | 160 006 | 44 581 | 25 250 213 | 13 279 392 | 456 452 |
| 22 469 | 1 370 | 12 613 | 68 997 | 174 952 | 30 604 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 116 827 | 73 503 | 57 618 | 8 416 744 | 3 160 656 | 168 858 |
| 7 324 | 12 471 | 8 999 | 1 782 120 | 627 902 | 35 810 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 52 892 |
| 1 566 | 28 542 | 1 187 | 710 983 | 129 260 | 36 475 |
| 3 | 52 280 | 0 | 2 260 | 1 143 685 | 33 649 |
| 166 434 | 328 172 | 124 998 | 36 231 317 | 18 515 847 | 814 740 |
| 2 247 689 | 226 860 | 1 716 740 | 21 606 489 | (10 019 192) | (669 923) |
| (3 223 911) | 664 192 | 325 289 | 239 704 899 | (46 606 559) | 286 192 |
| 542 945 | 688 153 | 43 051 | 45 434 193 | (2 087 451) | (68 479) |
| (433 277) | 1 579 205 | 2 085 080 | 306 745 581 | (58 713 202) | (452 210) |
| 6 868 469 | 1 742 578 | 1 463 113 | 374 656 072 | 139 186 676 | 3 060 766 |
| (6 714) | 135 045 | 95 024 | 6 035 000 | 3 424 760 | 350 807 |
| 6 428 478 | 3 456 828 | 3 643 217 | 687 436 653 | 83 898 234 | 2 959 363 |
| (25 413 533) | 3 927 128 | (13 215 103) | (33 325 627) | (351 822 968) | 85 540 256 |
| (100) | 0 | (1 174 726) | 0 | (7 986 761) | 0 |
| (18 985 155) | 7 383 956 | (10 746 612) | 654 111 026 | (275 911 495) | 88 499 619 |
| 78 625 703 | 22 671 529 | 34 189 490 | 2 047 856 178 | 1 273 817 005 | 5 531 791 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 59 640 548 | 30 055 485 | 23 442 878 | 2 701 967 204 | 997 905 510 | 94 031 410 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | Sustainable Multi-Asset Growth | Sustainable Multi-Asset Stability | Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | Sustainable US Multi-Factor Equity |
|---|------------------|--------------------------------|-----------------------------------|--|------------------------------------|
| | Exprimé en Notes | EUR | EUR | USD | USD |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 538 399 481 | 803 483 323 | 331 849 305 | 1 144 465 366 |
| Portefeuille-titres au coût d'acquisition | | 496 829 052 | 810 372 689 | 316 301 095 | 969 536 391 |
| Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres | | 38 161 341 | (16 995 991) | 7 036 107 | 156 580 992 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 534 990 393 | 793 376 698 | 323 337 202 | 1 126 117 383 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 973 303 | 952 990 | 2 532 630 | 6 623 512 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 1 176 564 | 3 769 493 | 2 514 580 | 9 677 421 |
| Autres actifs | | 1 259 221 | 5 384 142 | 3 464 893 | 2 047 050 |
| Passif | | 2 525 657 | 2 958 092 | 1 311 355 | 2 136 595 |
| Dettes bancaires à vue | | 312 929 | 248 602 | 1 225 606 | 0 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Autres passifs | | 2 212 728 | 2 709 490 | 85 749 | 2 136 595 |
| Valeur nette d'inventaire | | 535 873 824 | 800 525 231 | 330 537 950 | 1 142 328 771 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 432 835 | 10 649 963 | 13 190 256 | 15 779 798 |
| Commissions de gestion | 3 | 7 558 339 | 9 539 193 | 197 647 | 8 493 831 |
| Intérêts bancaires | | 45 880 | 94 395 | 102 862 | 46 118 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Autres frais | 6 | 1 687 113 | 2 664 256 | 560 944 | 3 256 664 |
| Taxes | 7 | 300 496 | 613 141 | 69 224 | 566 090 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Frais de transaction | 21 | 88 188 | 67 407 | 13 318 | 379 632 |
| Commissions de distribution | 4 | 720 166 | 651 445 | 0 | 240 860 |
| Total des charges | | 10 400 182 | 13 629 837 | 943 995 | 12 983 195 |
| Résultat net des investissements | | (9 967 347) | (2 979 874) | 12 246 261 | 2 796 603 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (8 658 685) | (55 780 548) | (9 077 417) | 63 781 087 |
| Instruments financiers | 2 | (806 269) | (754 941) | 667 765 | 21 962 987 |
| Résultat net réalisé | | (19 432 301) | (59 515 363) | 3 836 609 | 88 540 677 |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 66 796 879 | 122 656 301 | 18 793 220 | 79 443 555 |
| Instruments financiers | | 1 789 088 | 432 473 | 1 668 306 | 8 507 287 |
| Résultat des opérations | | 49 153 666 | 63 573 411 | 24 298 135 | 176 491 519 |
| Emissions/(rachats) nets | | (138 817 396) | (366 815 756) | 148 270 318 | (132 392 376) |
| Dividendes distribués | 8 | (1 682 987) | (5 025 635) | (2 716 439) | (471 040) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (91 346 717) | (308 267 980) | 169 852 014 | 43 628 103 |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 627 220 541 | 1 108 793 211 | 160 685 936 | 1 098 700 668 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | 0 |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 535 873 824 | 800 525 231 | 330 537 950 | 1 142 328 771 |

BNP PARIBAS FUNDS

| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | Target Risk Balanced | Turkey Equity | US Growth | US High Yield Bond | US Mid Cap |
|---|----------------------|---------------------|----------------------|--------------------|---------------------|
| USD | EUR | EUR | USD | USD | USD |
| 485 697 091 | 576 757 755 | 28 768 704 | 1 424 080 455 | 44 461 362 | 74 483 002 |
| 439 529 788 | 564 176 878 | 26 333 609 | 1 050 609 120 | 41 679 096 | 58 678 567 |
| 39 476 377 | 5 223 633 | 1 740 524 | 347 344 352 | 1 246 673 | 14 899 391 |
| 479 006 165 | 569 400 511 | 28 074 133 | 1 397 953 472 | 42 925 769 | 73 577 958 |
| 0 | 291 616 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 3 418 805 | 3 681 069 | 0 | 3 668 255 | 143 888 | 74 747 |
| 2 324 149 | 3 252 386 | 279 381 | 5 573 964 | 414 730 | 598 673 |
| 947 972 | 132 173 | 415 190 | 16 884 764 | 976 975 | 231 624 |
| 1 802 252 | 1 883 718 | 693 790 | 15 920 738 | 372 659 | 301 759 |
| 0 | 603 803 | 0 | 0 | 66 737 | 0 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1 802 252 | 1 279 915 | 693 790 | 15 920 738 | 305 922 | 301 759 |
| 483 894 839 | 574 874 037 | 28 074 914 | 1 408 159 717 | 44 088 703 | 74 181 243 |
| 8 125 804 | 4 035 813 | 1 118 769 | 6 355 063 | 2 794 137 | 843 900 |
| 4 393 637 | 4 199 433 | 572 328 | 13 657 660 | 544 855 | 1 212 078 |
| 23 707 | 2 438 | 904 | 56 083 | 8 750 | 230 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 1 631 846 | 1 499 012 | 131 581 | 3 892 274 | 136 341 | 279 585 |
| 307 037 | 779 476 | 21 370 | 674 339 | 34 427 | 50 529 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 303 851 | 438 808 | 228 985 | 422 872 | 167 | 22 408 |
| 13 482 | 132 080 | 17 328 | 38 361 | 58 843 | 8 231 |
| 6 673 560 | 7 051 247 | 972 496 | 18 741 589 | 783 383 | 1 573 061 |
| 1 452 244 | (3 015 434) | 146 273 | (12 386 526) | 2 010 754 | (729 161) |
| 11 540 057 | (10 255 255) | 10 274 677 | 88 370 344 | (1 581 645) | 4 101 850 |
| 12 289 190 | (4 903 181) | (346 685) | 1 782 909 | 230 212 | 204 532 |
| 25 281 491 | (18 173 870) | 10 074 265 | 77 766 727 | 659 321 | 3 577 221 |
| 26 373 738 | 49 093 546 | (13 575 669) | 312 211 195 | 4 225 667 | 7 933 924 |
| 3 244 593 | 5 631 582 | 0 | 375 951 | 34 677 | (131 390) |
| 54 899 822 | 36 551 258 | (3 501 404) | 390 353 873 | 4 919 665 | 11 379 755 |
| (255 107 535) | (308 226 160) | (37 118 953) | 53 299 153 | (8 173 107) | (11 126 749) |
| (222 106) | (4 311) | (42 006) | (227 234) | (2 016 219) | (68 253) |
| (200 429 819) | (271 679 213) | (40 662 363) | 443 425 792 | (5 269 661) | 184 753 |
| 684 324 658 | 846 553 250 | 68 737 277 | 964 733 925 | 49 358 364 | 73 996 490 |
| 0 | 0 | 0 | 0 | 0 | 0 |
| 483 894 839 | 574 874 037 | 28 074 914 | 1 408 159 717 | 44 088 703 | 74 181 243 |

BNP PARIBAS FUNDS

Etats financiers au 31/12/2023

| | | US Small Cap | USD Money Market | USD Short Duration Bond | Consolidé |
|---|---------------------|----------------------|----------------------|-------------------------|------------------------|
| | Exprimé en Notes | USD | USD | USD | EUR |
| Etat des actifs nets | | | | | |
| Actif | | 766 803 012 | 575 191 327 | 179 281 528 | 55 215 744 511 |
| <i>Portefeuille-titres au coût d'acquisition</i> | | 670 104 333 | 503 995 582 | 167 240 284 | 50 859 619 437 |
| <i>Plus/(moins)-value non réalisée sur portefeuille-titres</i> | | 76 263 038 | 9 445 890 | 3 243 077 | 2 609 375 900 |
| Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation | 2 | 746 367 371 | 513 441 472 | 170 483 361 | 53 468 995 337 |
| Options à la valeur de marché | 2,15 | 0 | 0 | 0 | 91 717 517 |
| Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 814 816 | 0 | 0 | 100 295 252 |
| Avoirs bancaires et dépôts à terme | | 14 090 665 | 42 505 918 | 4 910 120 | 981 099 637 |
| Autres actifs | | 5 530 160 | 19 243 937 | 3 888 047 | 573 636 768 |
| Passif | | 2 042 544 | 10 836 860 | 9 778 560 | 504 156 530 |
| Dettes bancaires à vue | | 0 | 0 | 0 | 16 467 375 |
| Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers | 2,11,12,13,14 | 0 | 119 243 | 857 430 | 95 678 030 |
| Autres passifs | | 2 042 544 | 10 717 617 | 8 921 130 | 392 011 125 |
| Valeur nette d'inventaire | | 764 760 468 | 564 354 467 | 169 502 968 | 54 711 587 981 |
| Etat des opérations et des changements des actifs nets | | | | | |
| Revenus sur titres et avoirs, nets | | 7 704 084 | 24 571 804 | 4 861 336 | 1 073 650 382 |
| Commissions de gestion | 3 | 7 817 483 | 1 549 836 | 708 317 | 494 523 961 |
| Intérêts bancaires | | 37 655 | 12 977 | 35 500 | 4 938 809 |
| Intérêts sur swaps | 2 | 0 | 17 628 979 | 0 | 87 395 153 |
| Autres frais | 6 | 1 904 315 | 626 637 | 436 023 | 149 609 050 |
| Taxes | 7 | 256 855 | 96 178 | 115 475 | 34 199 238 |
| Commissions de performance | 5 | 0 | 0 | 0 | 110 628 |
| Frais de transaction | 21 | 439 545 | 0 | 4 906 | 32 431 465 |
| Commissions de distribution | 4 | 15 973 | 0 | 11 279 | 12 797 244 |
| Total des charges | | 10 471 826 | 19 914 607 | 1 311 500 | 816 005 548 |
| Résultat net des investissements | | (2 767 742) | 4 657 197 | 3 549 836 | 257 644 834 |
| Résultat net réalisé sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | 2 | (21 148 483) | 20 073 645 | (1 482 384) | (1 231 924 887) |
| Instruments financiers | 2 | 3 541 662 | 12 500 | 2 564 166 | 242 034 115 |
| Résultat net réalisé | | (20 374 563) | 24 743 342 | 4 631 618 | (732 245 938) |
| Variation de la plus/(moins)-value nette non réalisée sur : | | | | | |
| Portefeuille-titres | | 138 119 078 | 4 252 955 | 5 588 244 | 5 674 077 462 |
| Instruments financiers | | (2 326 411) | (882 406) | (1 442 222) | (188 502 858) |
| Résultat des opérations | | 115 418 104 | 28 113 891 | 8 777 640 | 4 753 328 666 |
| Emissions/(rachats) nets | | (145 319 115) | (189 302 529) | (41 554 546) | (9 674 820 544) |
| Dividendes distribués | 8 | (247 481) | (323 286) | (1 913 992) | (203 035 323) |
| Augmentation/(diminution) des actifs nets durant l'exercice/période | | (30 148 492) | (161 511 924) | (34 690 898) | (5 124 527 201) |
| Actifs nets, début d'exercice/période | | 794 908 960 | 725 866 391 | 204 193 866 | 60 286 773 510 |
| Réévaluation de la VNI consolidée | | 0 | 0 | 0 | (450 658 328) |
| Actifs nets, fin de l'exercice/période | | 764 760 468 | 564 354 467 | 169 502 968 | 54 711 587 981 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Absolute Return Global Opportunities | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 13 503 010 | 10 974 739 | 0 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 90,22 | 88,18 | 0 | 0 |
| Action « I - Capitalisation » | 97 460,23 | 96 054,91 | 0 | 0 |
| Action « N - Capitalisation » | 81,99 | 79,54 | 0 | 0 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 93,58 | 92,06 | 0 | 0 |

| Aqua | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 4 278 009 259 | 3 448 466 572 | 3 742 064 147 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B USD - Capitalisation » | 0 | 82,53 | 98,66 | 10,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 221,26 | 181,17 | 211,22 | 5 675 728,408 |
| Action « Classic - Distribution » | 170,41 | 137,17 | 156,79 | 1 344 380,512 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 0 | 89,75 | 107,86 | 10,000 |
| Action « Classic RH CNH - Capitalisation » | 1 063,04 | 894,80 | 1 037,83 | 2 879,348 |
| Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | 0 | 995,80 | 1 126,62 | 100,000 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 2 000,53 | 1 733,06 | 2 090,89 | 1 246 910,796 |
| Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | 0 | 90,63 | 102,79 | 100,000 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 165,61 | 132,19 | 149,57 | 57 952,283 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 205,50 | 171,91 | 205,16 | 120 057,387 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 173,47 | 139,15 | 158,18 | 206 441,164 |
| Action « Classic SGD - Capitalisation » | 173,22 | 132,43 | 157,17 | 20 712,197 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 251,60 | 193,35 | 233,32 | 269 276,506 |
| Action « Classic USD - Distribution » | 164,33 | 124,04 | 146,82 | 12 399,679 |
| Action « I - Capitalisation » | 363,68 | 301,13 | 354,99 | 2 373 598,412 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 136,43 | 106,01 | 129,36 | 261 479,280 |
| Action « K - Capitalisation » | 136,18 | 110,67 | 128,06 | 1 232 493,802 |
| Action « Life - Capitalisation » | 206,70 | 171,76 | 203,22 | 2 292 137,231 |
| Action « N - Capitalisation » | 214,26 | 174,14 | 201,50 | 414 267,578 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 349,07 | 288,88 | 340,38 | 655 153,690 |
| Action « Privilège - Distribution » | 171,91 | 139,86 | 161,57 | 311 202,388 |
| Action « Privilège CHF - Capitalisation » | 165,87 | 130,82 | 145,12 | 6 682,593 |
| Action « Privilège GBP - Capitalisation » | 179,39 | 156,89 | 180,52 | 30 905,667 |
| Action « Privilège USD - Capitalisation » | 182,30 | 141,59 | 172,68 | 121 743,958 |
| Action « U11 H EUR - Capitalisation » | 101,11 | 79,06 | 92,37 | 365 065,679 |
| Action « U115 JPY - Capitalisation » | 0 | 0 | 11 957,00 | 396 550,261 |
| Action « U18 USD - Capitalisation » | 115,08 | 89,75 | 109,90 | 77 990,455 |
| Action « U19 - Capitalisation » | 101,54 | 84,38 | 99,78 | 133 022,492 |
| Action « X - Capitalisation » | 249,60 | 207,89 | 246,48 | 578 443,079 |

| Asia High Yield Bond | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|---------------------------------------|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 0 | 65 537 245 | 65 819 839 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 93,14 | 92,23 | 10,000 |
| Action « I - Distribution » | 0 | 93,62 | 82,02 | 802 500,000 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 0 | 93,47 | 93,32 | 10,000 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Asia Tech Innovators | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 0 | 22 380 618 | 20 913 711 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 762,13 | 763,31 | 22 901,822 |
| Action « Classic - Distribution » | 0 | 394,16 | 394,77 | 5 102,474 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 90,83 | 302,061 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 0 | 0 | 980,03 | 1 338,611 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 0 | 0 | 95,79 | 150,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 0 | 98,77 | 100,05 | 10,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 0 | 98,55 | 98,00 | 10,000 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 0 | 98,75 | 99,94 | 10,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 98,75 | 99,94 | 10,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 98 862,00 | 101 033,08 | 13,010 |
| Belgium Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 210 123 413 | 172 991 393 | 141 391 411 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 1 124,32 | 992,42 | 1 007,92 | 119 191,749 |
| Action « Classic - Distribution » | 383,41 | 330,63 | 322,32 | 65 944,071 |
| Brazil Equity | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 109 936 095 | 80 215 416 | 80 086 348 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 77,63 | 79,16 | 95,76 | 707 351,246 |
| Action « Classic - Distribution » | 47,13 | 46,92 | 52,34 | 37 013,149 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 68,27 | 74,19 | 86,71 | 34 368,203 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 0 | 0 | 47,38 | 334,955 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 965,01 | 56 405,856 |
| Action « N - Capitalisation » | 69,36 | 70,21 | 84,30 | 18 968,291 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 70,50 | 72,67 | 88,78 | 1 148,660 |
| China A-Shares | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 157 600 976 | 146 789 544 | 125 261 375 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 287,04 | 201,34 | 173,90 | 26 666,768 |
| Action « Classic - Distribution » | 136,80 | 94,16 | 79,76 | 929,135 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 306,42 | 229,03 | 191,11 | 145 022,302 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 0 | 0 | 1 357,82 | 1 214,166 |
| Action « I - Capitalisation » | 226,59 | 160,80 | 140,51 | 215 808,818 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 199,27 | 150,69 | 127,21 | 411 929,862 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 197,87 | 140,20 | 122,31 | 11 514,850 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 110,71 | 878,901 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| China Equity | USD | USD | USD | Nombre d'actions 31/12/2023 |
|---|---------------|---------------|-------------|--------------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 2 103 580 535 | 1 229 109 554 | 838 485 238 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 590,77 | 422,92 | 340,30 | 282 354,708 |
| Action « Classic - Distribution » | 339,23 | 237,72 | 187,21 | 32 097,839 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 219,49 | 167,42 | 130,16 | 1 645 344,966 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 166,45 | 124,39 | 94,60 | 111 658,764 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 80,74 | 57,28 | 45,61 | 70 043,724 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 3 455,91 | 12 728,103 |
| Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | 72,41 | 50,26 | 39,30 | 22 426,687 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 82,37 | 58,48 | 46,00 | 315 219,131 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 81,05 | 56,09 | 43,99 | 173,132 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 3 429,40 | 15 142,630 |
| Action « I - Capitalisation » | 689,53 | 499,14 | 406,11 | 819 269,011 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 145,62 | 112,32 | 88,29 | 681 787,279 |
| Action « K EUR - Capitalisation » | 0 | 76,83 | 59,28 | 53 299,938 |
| Action « N - Capitalisation » | 526,88 | 374,34 | 298,96 | 56 358,495 |
| Action « N EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 270,63 | 221,965 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 200,09 | 144,68 | 117,59 | 191 771,950 |
| Action « Privilege - Distribution » | 161,46 | 114,30 | 90,93 | 2 550,246 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 116,31 | 89,62 | 70,37 | 267 228,816 |
| Action « X - Capitalisation » | 95,95 | 70,08 | 0 | 0 |
| Action « X AUD - Capitalisation » | 92 741,44 | 72 661,94 | 0 | 0 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Climate Impact | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions 31/12/2023 |
|--|---------------|---------------|---------------|--------------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 3 807 224 947 | 2 640 233 960 | 2 788 348 830 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 310,99 | 241,44 | 259,32 | 6 198 338,758 |
| Action « Classic - Distribution » | 233,39 | 177,98 | 187,14 | 374 805,649 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 149,81 | 110,90 | 120,27 | 553 995,402 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 0 | 88,95 | 99,27 | 10,000 |
| Action « Classic RH CNH - Capitalisation » | 0 | 863,67 | 922,37 | 100,000 |
| Action « Classic RH HKD - Capitalisation » | 0 | 90,92 | 98,90 | 100,000 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 99,82 | 79,03 | 85,28 | 100,000 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 0 | 91,12 | 100,10 | 100,000 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 171,58 | 125,02 | 138,98 | 131 001,585 |
| Action « I - Capitalisation » | 376,51 | 296,32 | 322,63 | 1 960 087,419 |
| Action « I - Distribution » | 103,22 | 79,80 | 85,05 | 9,222 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 166,32 | 131,43 | 143,69 | 766 618,524 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 0 | 90,07 | 101,54 | 10,000 |
| Action « K - Capitalisation » | 0 | 84,17 | 89,72 | 206 583,541 |
| Action « N - Capitalisation » | 255,79 | 197,10 | 210,12 | 111 455,917 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 2 922,31 | 2 297,47 | 2 498,61 | 37 780,345 |
| Action « Privilege - Distribution » | 184,75 | 142,68 | 151,92 | 158 385,578 |
| Action « Privilege RH CHF - Distribution » | 0 | 96,24 | 101,27 | 100,000 |
| Action « Privilege RH EUR - Capitalisation » | 0 | 96,32 | 105,41 | 1 354,000 |
| Action « Privilege RH EUR - Distribution » | 106,22 | 74,41 | 79,74 | 789,611 |
| Action « Privilege RH GBP - Distribution » | 106,38 | 75,03 | 81,56 | 59 515,967 |
| Action « Privilege USD - Capitalisation » | 182,10 | 134,36 | 151,23 | 502 386,765 |
| Action « Privilege USD - Distribution » | 107,05 | 77,52 | 85,49 | 145 951,232 |
| Action « U2 HKD - Capitalisation » | 0 | 89,67 | 101,77 | 32,741 |
| Action « U2 HKD - Distribution » | 114,20 | 82,34 | 90,34 | 60 139,868 |
| Action « U2 HKD MD - Distribution » | 0 | 88,65 | 96,79 | 2 587,802 |
| Action « U2 RH AUD - Distribution » | 108,05 | 75,48 | 80,37 | 14 188,121 |
| Action « U2 RH CHF - Distribution » | 102,15 | 70,90 | 74,20 | 2 000,000 |
| Action « U2 RH CNH - Capitalisation » | 0 | 888,93 | 965,08 | 100,000 |
| Action « U2 RH CNH - Distribution » | 110,80 | 79,68 | 84,73 | 3 383,564 |
| Action « U2 RH CNH MD - Distribution » | 0 | 868,95 | 920,86 | 100,000 |
| Action « U2 RH EUR - Capitalisation » | 0 | 96,16 | 104,75 | 340,916 |
| Action « U2 RH EUR - Distribution » | 0 | 96,09 | 102,44 | 100,000 |
| Action « U2 RH EUR MD - Distribution » | 0 | 87,03 | 93,47 | 716,959 |
| Action « U2 RH GBP - Distribution » | 110,53 | 77,44 | 83,73 | 8 271,099 |
| Action « U2 RH SGD - Capitalisation » | 108,09 | 78,43 | 86,03 | 14 195,021 |
| Action « U2 RH SGD - Distribution » | 0 | 97,28 | 104,51 | 100,000 |
| Action « U2 RH SGD MD - Distribution » | 0 | 88,08 | 94,63 | 4 702,175 |
| Action « U2 RH USD - Capitalisation » | 0 | 87,77 | 97,16 | 100,000 |
| Action « U2 USD - Capitalisation » | 122,35 | 89,78 | 100,51 | 278 964,432 |
| Action « U2 USD - Distribution » | 107,65 | 77,53 | 85,02 | 14 762,932 |
| Action « U2 USD MD - Distribution » | 0 | 88,82 | 96,21 | 31,486 |
| Action « X - Capitalisation » | 209,08 | 165,59 | 181,36 | 45 336,578 |
| Action « X - Distribution » | 175,01 | 0 | 108 965,85 | 4,621 |
| Consumer Innovators | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 573 523 079 | 917 965 197 | 892 255 837 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B USD - Capitalisation » | 0 | 73,72 | 91,22 | 3 635,193 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 347,72 | 249,05 | 300,72 | 1 937 547,463 |
| Action « Classic - Distribution » | 245,28 | 174,24 | 207,86 | 230 148,271 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 136,64 | 90,95 | 111,60 | 258 423,452 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 100,49 | 73,51 | 89,25 | 100,000 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 395,46 | 265,81 | 332,21 | 172 429,152 |
| Action « I - Capitalisation » | 424,42 | 307,07 | 374,55 | 273 223,893 |
| Action « K - Capitalisation » | 114,47 | 81,37 | 97,52 | 296 052,156 |
| Action « N - Capitalisation » | 400,65 | 284,80 | 341,33 | 56 429,314 |
| Action « N USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 377,02 | 3 886,204 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 464,90 | 336,00 | 409,38 | 47 599,870 |
| Action « Privilege - Distribution » | 303,53 | 217,58 | 261,92 | 36 148,399 |
| Action « X - Capitalisation » | 145,51 | 0 | 0 | 0 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Disruptive Technology | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 3 583 041 646 | 2 821 389 665 | 3 951 133 235 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B USD - Capitalisation » | 119,00 | 81,63 | 114,04 | 7 284,100 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 2 110,72 | 1 558,24 | 2 124,39 | 797 463,218 |
| Action « Classic - Distribution » | 1 644,87 | 1 193,29 | 1 596,95 | 87 777,175 |
| Action « Classic CZK - Capitalisation » | 2 337,20 | 1 677,07 | 2 336,96 | 612 139,570 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 209,46 | 140,69 | 193,83 | 1 532 591,789 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 0 | 87,58 | 121,87 | 3 156,500 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 2 409,63 | 1 669,50 | 2 355,81 | 47 182,246 |
| Action « Classic USD - Distribution » | 580,69 | 395,04 | 547,46 | 22 164,621 |
| Action « I - Capitalisation » | 2 437,51 | 1 817,78 | 2 503,43 | 199 302,930 |
| Action « I GBP - Capitalisation » | 216,26 | 170,43 | 229,24 | 2 641,595 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 200,08 | 149,43 | 206,10 | 1 087 301,292 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 197,85 | 138,47 | 197,38 | 352 380,761 |
| Action « K - Capitalisation » | 131,88 | 96,63 | 130,75 | 432 029,359 |
| Action « N - Capitalisation » | 940,25 | 688,94 | 932,22 | 99 628,576 |
| Action « N USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 1 029,65 | 1 596,519 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 675,66 | 503,32 | 692,38 | 182 585,214 |
| Action « Privilege - Distribution » | 532,31 | 389,69 | 526,23 | 109 217,637 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 208,79 | 141,57 | 196,73 | 68 326,289 |
| Action « Privilege RH USD - Capitalisation » | 264,01 | 202,02 | 283,91 | 2 579,999 |
| Action « Privilege USD - Capitalisation » | 235,42 | 164,59 | 234,35 | 102 394,750 |
| Action « UI6 H EUR - Capitalisation » | 131,16 | 89,25 | 124,48 | 502 800,000 |
| Action « UP4 - Distribution » | 179,77 | 131,87 | 178,44 | 444 942,193 |
| Action « X - Capitalisation » | 181,98 | 136,73 | 189,70 | 47 726,449 |
| Action « X - Distribution » | 0 | 0 | 106 918,09 | 2 716,426 |
| Action « X NOK - Capitalisation » | 1 114 228,15 | 877 621,13 | 1 299,32 | 435 026,924 |

| Ecosystem Restoration | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 210 473 302 | 131 050 169 | 83 681 002 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 80,10 | 48,58 | 35,87 | 180 004,752 |
| Action « Classic - Distribution » | 80,11 | 47,72 | 34,30 | 45 964,467 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 80,11 | 48,61 | 35,78 | 3 660,834 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 75,54 | 43,65 | 34,07 | 10,000 |
| Action « Classic RH CNH - Capitalisation » | 819,84 | 511,43 | 376,30 | 100,000 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 807,38 | 517,86 | 394,52 | 19 338,920 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 80,64 | 49,91 | 37,11 | 100,000 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 74,43 | 42,36 | 32,37 | 980,720 |
| Action « I - Capitalisation » | 80,60 | 49,37 | 36,82 | 23 524,588 |
| Action « I JPY - Capitalisation » | 8 460,00 | 5 581,00 | 4 594,00 | 10,000 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 74,90 | 43,11 | 33,24 | 10,000 |
| Action « IH EUR - Capitalisation » | 80,59 | 49,56 | 36,75 | 100,000 |
| Action « IH JPY - Capitalisation » | 8 478,00 | 5 188,00 | 3 714,00 | 300,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 79,76 | 47,99 | 35,17 | 13 586,934 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 80,56 | 49,29 | 36,73 | 1 675,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 80,52 | 48,50 | 35,18 | 10,000 |
| Action « Privilege RH GBP - Capitalisation » | 80,79 | 49,76 | 37,56 | 100,000 |
| Action « Privilege USD - Capitalisation » | 75,01 | 43,10 | 33,18 | 10,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 80 881,91 | 49 912,55 | 94 672,41 | 779,000 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Emerging Bond | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 685 613 056 | 448 164 663 | 421 703 067 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B MD - Distribution » | 91,27 | 61,86 | 60,28 | 3 248,146 |
| Action « BH AUD MD - Distribution » | 90,99 | 60,10 | 57,46 | 600,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 484,13 | 385,63 | 426,96 | 28 718,550 |
| Action « Classic - Distribution » | 71,89 | 53,94 | 55,35 | 90 268,602 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 424,62 | 360,40 | 385,51 | 10 506,744 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 255,58 | 204,92 | 202,72 | 8 758,991 |
| Action « Classic H AUD MD - Distribution » | 66,61 | 44,62 | 43,32 | 14 831,435 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 98,53 | 76,12 | 82,25 | 100 819,953 |
| Action « Classic H EUR - Distribution » | 78,89 | 57,43 | 57,48 | 69 822,672 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 80,81 | 55,39 | 54,58 | 252 147,534 |
| Action « I - Capitalisation » | 40,71 | 32,72 | 36,55 | 972 906,001 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 33,09 | 129 199,652 |
| Action « IH EUR - Capitalisation » | 113,82 | 88,67 | 96,68 | 2 429 825,134 |
| Action « N - Capitalisation » | 432,65 | 342,90 | 377,75 | 8 449,804 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 31,65 | 25,38 | 28,30 | 589 191,800 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 101,60 | 78,89 | 85,72 | 19 531,072 |
| Action « X - Capitalisation » | 145,76 | 117,79 | 132,30 | 358 299,599 |
| Action « X EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 119,76 | 8 250,560 |
| Emerging Bond Opportunities | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 508 131 117 | 307 805 171 | 288 031 851 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B MD - Distribution » | 89,04 | 63,85 | 62,92 | 1 838,245 |
| Action « B RH AUD MD - Distribution » | 88,81 | 62,28 | 60,26 | 100,000 |
| Action « B RH ZAR MD - Distribution » | 901,36 | 623,01 | 602,89 | 100,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 216,72 | 181,90 | 201,20 | 111 911,029 |
| Action « Classic - Distribution » | 121,93 | 95,80 | 98,34 | 16 206,512 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 98,26 | 82,50 | 81,64 | 1 113,797 |
| Action « Classic EUR MD - Distribution » | 73,75 | 57,85 | 55,24 | 19 954,474 |
| Action « Classic GBP - Distribution » | 0 | 0 | 77,14 | 70,086 |
| Action « Classic HKD MD - Distribution » | 68,63 | 49,85 | 49,65 | 275 874,251 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 15,28 | 11,11 | 11,07 | 11 740 431,833 |
| Action « Classic MD2 - Distribution » | 0 | 80,14 | 81,03 | 10,000 |
| Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | 67,28 | 47,74 | 46,69 | 52 613,429 |
| Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | 669,35 | 465,05 | 452,56 | 939,152 |
| Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | 65,61 | 53,36 | 57,60 | 286 547,473 |
| Action « Classic RH EUR - Distribution » | 17,09 | 13,01 | 13,00 | 156 793,637 |
| Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | 68,85 | 49,61 | 48,77 | 326 400,000 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 68,15 | 48,96 | 48,45 | 1 951,218 |
| Action « Classic RH ZAR MD - Distribution » | 657,69 | 460,26 | 450,93 | 32 880,800 |
| Action « I - Capitalisation » | 121,60 | 103,18 | 115,38 | 471 408,911 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 104,45 | 53 000,000 |
| Action « I RH EUR - Capitalisation » | 77,61 | 63,76 | 69,50 | 71 210,386 |
| Action « N - Capitalisation » | 118,07 | 98,60 | 108,52 | 11 199,226 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 104,26 | 88,26 | 98,47 | 88 341,391 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 102,37 | 92,35 | 99,53 | 193 532,096 |
| Action « Privilege RH EUR - Distribution » | 57,37 | 43,98 | 44,37 | 171 287,697 |
| Action « X - Capitalisation » | 125,82 | 107,40 | 0 | 0 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Emerging Equity | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 358 297 606 | 230 368 249 | 181 876 085 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B - Capitalisation » | 82,67 | 63,32 | 66,09 | 1 973,030 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 651,32 | 504,13 | 531,73 | 126 514,532 |
| Action « Classic - Distribution » | 139,02 | 105,15 | 107,60 | 120 438,826 |
| Action « Classic CZK - Capitalisation » | 961,93 | 771,11 | 803,17 | 41 862,284 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 126,95 | 104,70 | 106,69 | 390 781,188 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 96,69 | 78,01 | 77,07 | 38 118,373 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 5 399,97 | 1 227,941 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 5 358,57 | 1 222,257 |
| Action « I - Capitalisation » | 785,33 | 614,65 | 655,56 | 9 532,145 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 101,46 | 84,62 | 87,18 | 50 376,692 |
| Action « N - Capitalisation » | 185,79 | 142,75 | 149,45 | 18 693,317 |
| Action « N EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 135,32 | 109,420 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 107,49 | 84,03 | 89,52 | 157 293,483 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 101,25 | 84,34 | 86,81 | 4 311,832 |
| Action « X - Capitalisation » | 119,09 | 94,05 | 101,21 | 207 506,440 |
| Emerging Markets Climate Solutions | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 0 | 86 121 152 | 122 740 894 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 85,92 | 84,30 | 10,000 |
| Action « Classic - Distribution » | 0 | 85,92 | 81,85 | 10,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 0 | 86,42 | 85,68 | 410,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 0 | 85,57 | 83,26 | 10,000 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 0 | 86,33 | 85,47 | 10,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 86,33 | 83,01 | 10,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 86 784,37 | 86 823,81 | 730,100 |
| Action « X EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 95 104,52 | 564,564 |
| Energy Transition | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 3 001 296 860 | 1 952 485 489 | 1 445 669 663 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B USD - Capitalisation » | 83,09 | 49,70 | 37,80 | 77 472,572 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 1 109,15 | 714,11 | 530,07 | 684 866,669 |
| Action « Classic - Distribution » | 590,01 | 372,41 | 270,19 | 180 775,623 |
| Action « Classic GBP - Distribution » | 0 | 0 | 234,12 | 19,710 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 71,20 | 45,87 | 34,03 | 143 229,413 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 100,53 | 60,80 | 46,75 | 7 641,421 |
| Action « Classic RH CNH - Capitalisation » | 933,08 | 618,08 | 458,26 | 47 571,528 |
| Action « Classic RH HKD - Capitalisation » | 0 | 76,99 | 58,43 | 100,000 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 77,86 | 51,45 | 38,42 | 240 357,680 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 89,88 | 59,74 | 45,70 | 15 164,923 |
| Action « Classic Solidarity H EUR - Capitalisation » | 75,70 | 48,77 | 36,18 | 221 969,169 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 159,87 | 96,60 | 74,22 | 7 021 533,934 |
| Action « Classic USD - Distribution » | 669,41 | 396,16 | 297,67 | 28 533,824 |
| Action « I - Capitalisation » | 1 302,86 | 847,36 | 635,38 | 214 845,215 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 75,66 | 49,28 | 37,01 | 467 482,331 |
| Action « I RH GBP - Capitalisation » | 93,85 | 61,67 | 46,77 | 100,000 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 88,69 | 54,14 | 42,01 | 59 690,393 |
| Action « K - Capitalisation » | 80,85 | 51,66 | 38,06 | 742 266,794 |
| Action « N - Capitalisation » | 991,20 | 633,38 | 466,63 | 117 359,460 |
| Action « N USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 515,43 | 11 327,975 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 200,15 | 130,02 | 97,38 | 1 689 481,257 |
| Action « Privilege - Distribution » | 152,60 | 97,20 | 71,16 | 296 999,046 |
| Action « Privilege H USD - Capitalisation » | 72,71 | 49,02 | 38,03 | 105 481,774 |
| Action « Privilege RH GBP - Capitalisation » | 93,84 | 61,58 | 46,65 | 100,000 |
| Action « Privilege USD - Capitalisation » | 88,57 | 54,04 | 41,88 | 71 699,479 |
| Action « X - Capitalisation » | 2 676,36 | 1 753,62 | 1 324,82 | 69 910,120 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Enhanced Bond 6M | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 4 145 789 530 | 3 160 083 258 | 2 285 084 686 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 110,29 | 106,27 | 110,85 | 1 579 235,381 |
| Action « Classic - Distribution » | 102,78 | 99,03 | 101,08 | 215 498,265 |
| Action « I - Capitalisation » | 114,60 | 110,67 | 115,71 | 9 179 021,199 |
| Action « I - Distribution » | 101,18 | 97,71 | 99,96 | 200 200,000 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 101,30 | 97,87 | 102,37 | 6 102 194,958 |
| Action « N - Capitalisation » | 106,53 | 102,55 | 106,85 | 227 140,061 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 90,14 | 86,98 | 90,88 | 1 183 917,394 |
| Action « Privilège - Distribution » | 103,42 | 99,80 | 102,04 | 39 047,795 |
| Action « X - Capitalisation » | 116,80 | 112,89 | 118,13 | 2 079 209,998 |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 431 263 439 | 78 184 199 | 25 057 900 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 101,69 | 73,63 | 61,28 | 98 296,155 |
| Action « Classic - Distribution » | 103,00 | 74,58 | 62,06 | 12 337,607 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 1 086,26 | 815,66 | 675,85 | 112 180,637 |
| Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | 104,30 | 73,14 | 58,99 | 106 150,802 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 85,59 | 61,53 | 49,91 | 100,000 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 617,37 | 1 013,414 |
| Action « I - Capitalisation » | 73,18 | 53,45 | 0 | 0 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 78,98 | 61,48 | 49,85 | 6 082,514 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 121,14 | 88,47 | 74,26 | 54 912,200 |
| Action « I RH EUR - Capitalisation » | 75,54 | 53,35 | 43,35 | 37 000,000 |
| Action « IH JPY - Capitalisation » | 8 804,00 | 0 | 0 | 0 |
| Action « N - Capitalisation » | 74,68 | 53,67 | 44,32 | 13 310,971 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 103,33 | 75,43 | 63,27 | 14 941,925 |
| Action « Privilège - Distribution » | 73,86 | 53,91 | 0 | 0 |
| Action « Privilège RH EUR - Capitalisation » | 73,06 | 51,99 | 42,17 | 850,000 |
| Action « U7 - Capitalisation » | 71,43 | 52,14 | 0 | 0 |
| Action « X - Capitalisation » | 123 380,03 | 90 795,77 | 0 | 0 |
| Action « X AUD - Capitalisation » | 90 715,82 | 71 563,92 | 60 147,25 | 3,284 |
| Euro Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 748 798 269 | 549 763 393 | 430 381 101 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 226,13 | 187,11 | 199,11 | 491 830,101 |
| Action « Classic - Distribution » | 115,21 | 95,33 | 97,99 | 341 021,347 |
| Action « I - Capitalisation » | 23,32 | 19,42 | 20,80 | 11 466 094,748 |
| Action « K - Capitalisation » | 0 | 0 | 105,21 | 7 141,302 |
| Action « N - Capitalisation » | 202,72 | 166,90 | 176,72 | 13 287,322 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 169,37 | 140,78 | 150,48 | 276 764,083 |
| Action « Privilège - Distribution » | 115,10 | 95,67 | 98,79 | 94 216,019 |
| Action « X - Capitalisation » | 129,20 | 107,92 | 115,92 | 55 956,257 |
| Euro Bond Opportunities | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 258 747 342 | 183 155 558 | 180 515 331 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 446,38 | 368,26 | 396,13 | 204 784,216 |
| Action « Classic - Distribution » | 26,34 | 21,73 | 22,58 | 1 480 905,635 |
| Action « I - Capitalisation » | 494,61 | 410,65 | 444,56 | 92 763,473 |
| Action « N - Capitalisation » | 142,88 | 117,29 | 125,53 | 19 323,378 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 123,91 | 102,68 | 110,95 | 200 916,824 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Euro Corporate Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 668 538 967 | 1 299 006 084 | 1 074 194 388 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 197,09 | 167,47 | 181,72 | 609 337,148 |
| Action « Classic - Distribution » | 117,87 | 99,50 | 103,43 | 433 278,836 |
| Action « Classic H CZK - Capitalisation » | 11 579,54 | 10 416,71 | 11 723,75 | 11 365,406 |
| Action « I - Capitalisation » | 223,33 | 190,99 | 208,56 | 1 891 438,124 |
| Action « I - Distribution » | 109,80 | 93,25 | 97,57 | 42 334,158 |
| Action « K - Capitalisation » | 0 | 0 | 104,68 | 7 538,897 |
| Action « N - Capitalisation » | 177,94 | 150,44 | 162,43 | 23 692,917 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 169,30 | 144,51 | 157,51 | 171 253,464 |
| Action « Privilege - Distribution » | 117,95 | 100,02 | 104,45 | 539 011,331 |
| Action « X - Capitalisation » | 241,63 | 207,26 | 227,01 | 924 653,325 |
| Action « X - Distribution » | 210,07 | 179,00 | 187,85 | 1 154 227,022 |
| Euro Corporate Bond Opportunities | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 254 899 208 | 160 867 365 | 102 495 232 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 116,09 | 96,82 | 104,25 | 762 595,206 |
| Action « Classic - Distribution » | 109,24 | 90,51 | 93,34 | 70 637,274 |
| Action « I - Capitalisation » | 107,29 | 90,05 | 106,29 | 316,350 |
| Action « K - Capitalisation » | 98,16 | 81,26 | 86,83 | 131 810,690 |
| Action « N - Capitalisation » | 102,42 | 85,00 | 91,06 | 54 025,963 |
| Action « X - Capitalisation » | 107,69 | 90,66 | 0 | 0 |
| Euro Corporate Green Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 0 | 130 899 024 | 101 107 115 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 101,38 | 108,68 | 150,761 |
| Action « Classic - Distribution » | 0 | 101,38 | 108,55 | 10,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 0 | 101,51 | 109,38 | 39 085,000 |
| Action « I - Distribution » | 0 | 101,52 | 109,35 | 10,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 0 | 101,29 | 108,03 | 10,000 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 0 | 101,45 | 109,00 | 10,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 101,45 | 109,00 | 10,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 101 573,72 | 109 782,01 | 881,840 |
| Euro Defensive Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 140 218 793 | 118 943 653 | 215 946 817 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 186,51 | 160,75 | 185,40 | 60 742,247 |
| Action « Classic - Distribution » | 128,68 | 108,49 | 121,56 | 2 745,743 |
| Action « I - Capitalisation » | 145,51 | 126,49 | 147,14 | 778 997,757 |
| Action « I - Distribution » | 116,15 | 98,78 | 111,66 | 145 970,916 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 127,18 | 110,32 | 128,07 | 262,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 118 220,16 | 103 274,86 | 120 741,53 | 607,856 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Euro Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 1 699 815 604 | 1 353 736 795 | 1 441 877 740 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 695,13 | 611,23 | 703,28 | 1 177 963,375 |
| Action « Classic - Distribution » | 339,84 | 292,13 | 326,53 | 175 189,094 |
| Action « Classic H CZK - Capitalisation » | 6 119,01 | 5 669,49 | 6 750,20 | 17 726,436 |
| Action « Classic H USD - Capitalisation » | 189,08 | 170,96 | 201,71 | 2 603,559 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 6 796,84 | 7 829,21 | 695,749 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 790,69 | 652,49 | 777,08 | 2 080,565 |
| Action « I - Capitalisation » | 837,51 | 743,91 | 864,66 | 398 785,391 |
| Action « I - Distribution » | 140,12 | 0 | 0 | 0 |
| Action « K - Capitalisation » | 121,20 | 105,77 | 120,79 | 367 181,241 |
| Action « N - Capitalisation » | 622,75 | 543,49 | 620,68 | 14 871,299 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 243,27 | 215,85 | 250,60 | 295 857,381 |
| Action « Privilege - Distribution » | 157,08 | 136,26 | 153,70 | 20 285,789 |
| Action « X - Capitalisation » | 264,99 | 237,12 | 277,69 | 263 973,547 |
| Euro Flexible Bond | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 0 | 433 366 405 | 305 072 356 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 99,55 | 100,56 | 884 808,232 |
| Action « Classic - Distribution » | 0 | 99,37 | 100,38 | 419 061,133 |
| Action « I - Capitalisation » | 0 | 104,97 | 106,69 | 486 047,899 |
| Action « N - Capitalisation » | 0 | 99,05 | 99,55 | 19 227,355 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 0 | 99,64 | 101,07 | 98 416,165 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 99,65 | 101,07 | 98 383,506 |
| Action « U12 - Distribution » | 0 | 95,16 | 96,12 | 438 277,246 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 99,95 | 101,89 | 571 600,754 |
| Euro Government Bond | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 252 222 322 | 1 298 468 468 | 1 827 755 053 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 415,58 | 344,67 | 364,48 | 526 992,069 |
| Action « Classic - Distribution » | 120,12 | 99,63 | 102,02 | 100 430,043 |
| Action « I - Capitalisation » | 228,03 | 190,33 | 202,58 | 6 214 830,731 |
| Action « K - Capitalisation » | 0 | 0 | 105,57 | 5 698,867 |
| Action « N - Capitalisation » | 373,47 | 308,19 | 324,28 | 19 736,724 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 225,80 | 188,11 | 199,88 | 402 498,197 |
| Action « Privilege - Distribution » | 122,71 | 102,23 | 105,17 | 63 836,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 501,05 | 419,27 | 447,36 | 608 656,830 |
| Euro High Quality Government Bond | | | | |
| | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 242 675 478 | 194 928 938 | 0 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 120,93 | 99,78 | 0 | 0 |
| Action « Classic - Distribution » | 117,07 | 96,58 | 0 | 0 |
| Action « I - Capitalisation » | 13 075,11 | 10 823,99 | 0 | 0 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 102,21 | 84,46 | 0 | 0 |
| Action « X - Capitalisation » | 118,61 | 98,36 | 0 | 0 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Euro High Yield Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions 31/12/2023 |
|---|-------------|-------------|-------------|--------------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 686 187 774 | 566 507 312 | 563 250 947 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 229,09 | 199,15 | 222,32 | 235 041,666 |
| Action « Classic - Distribution » | 100,10 | 83,70 | 86,80 | 639 752,199 |
| Action « Classic H USD MD - Distribution » | 98,57 | 82,70 | 85,31 | 300,000 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 90,65 | 74,85 | 77,07 | 26 712,750 |
| Action « I - Capitalisation » | 264,74 | 232,07 | 261,25 | 1 058 633,784 |
| Action « I - Distribution » | 103,10 | 86,93 | 90,93 | 189 820,342 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 0 | 0 | 101,64 | 250 001,000 |
| Action « K - Capitalisation » | 102,61 | 88,52 | 98,08 | 153 148,215 |
| Action « N - Capitalisation » | 111,40 | 96,36 | 107,03 | 17 731,865 |
| Action « N - Distribution » | 121,12 | 100,77 | 103,96 | 45 291,854 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 161,96 | 141,77 | 159,38 | 103 642,328 |
| Action « Privilege - Distribution » | 104,34 | 87,87 | 91,78 | 24 344,228 |
| Action « X - Capitalisation » | 175,92 | 155,06 | 175,53 | 534 178,773 |
| | | | | |
| Euro High Yield Short Duration Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions 31/12/2023 |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 260 820 114 | 260 418 073 | 321 613 237 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 115,90 | 107,49 | 117,06 | 1 003 950,182 |
| Action « Classic - Distribution » | 93,81 | 84,36 | 85,69 | 107 153,311 |
| Action « Classic H USD - Capitalisation » | 130,85 | 123,89 | 137,86 | 42 612,598 |
| Action « Classic H USD - Distribution » | 97,47 | 89,54 | 92,86 | 19 099,836 |
| Action « I - Capitalisation » | 122,62 | 114,62 | 125,82 | 1 400 876,158 |
| Action « N - Distribution » | 92,85 | 83,07 | 83,93 | 42 627,857 |
| Action « NH USD - Capitalisation » | 125,45 | 118,39 | 130,92 | 7 872,327 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 105,47 | 98,30 | 107,59 | 10 851,295 |
| Action « Privilege H USD - Capitalisation » | 135,74 | 129,51 | 144,56 | 12,585 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 100 103,20 | 110 095,86 | 55,000 |
| | | | | |
| Euro Inflation-Linked Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions 31/12/2023 |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 294 655 402 | 230 737 122 | 185 534 509 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 154,65 | 139,55 | 146,31 | 267 760,528 |
| Action « Classic - Distribution » | 127,21 | 114,79 | 116,46 | 81 446,386 |
| Action « I - Capitalisation » | 173,22 | 157,21 | 165,75 | 530 981,403 |
| Action « N - Capitalisation » | 141,69 | 127,22 | 132,72 | 70 022,366 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 131,80 | 119,45 | 125,73 | 13 477,889 |
| Action « Privilege - Distribution » | 123,17 | 111,60 | 113,69 | 13 965,846 |
| Action « X - Capitalisation » | 132,83 | 90 462,45 | 95 596,65 | 379,563 |
| | | | | |
| Euro Medium Term Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions 31/12/2023 |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 359 026 046 | 228 100 237 | 260 040 239 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 183,88 | 165,63 | 174,29 | 620 459,360 |
| Action « Classic - Distribution » | 107,09 | 96,46 | 98,04 | 242 182,576 |
| Action « I - Capitalisation » | 192,61 | 174,35 | 184,37 | 270 135,330 |
| Action « K - Capitalisation » | 0 | 0 | 102,92 | 35 591,705 |
| Action « N - Capitalisation » | 165,24 | 148,10 | 155,06 | 18 487,088 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 139,05 | 125,69 | 132,73 | 451 634,346 |
| Action « Privilege - Distribution » | 108,50 | 98,08 | 100,04 | 118 738,579 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Euro Money Market | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 833 868 452 | 1 348 929 917 | 2 167 405 722 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 205,275761 | 205,007074 | 211,483499 | 7 431 366,313 |
| Action « Classic - Distribution » | 101,148610 | 101,016412 | 104,207458 | 1 376 892,435 |
| Action « Classic Plus - Distribution » | 0 | 0 | 101,154741 | 275 569,790 |
| Action « I - Capitalisation » | 70,824801 | 70,766027 | 73,154188 | 2 546 428,564 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 967,570743 | 966,425661 | 998,535580 | 115 639,938 |
| Action « Privilège - Distribution » | 98,294842 | 98,178484 | 101,440032 | 1 141 479,480 |
| Action « X - Capitalisation » | 220,734591 | 0 | 102 871,561917 | 67,001 |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 460 221 035 | 451 250 820 | 373 954 633 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 127,50 | 116,38 | 121,95 | 1 138 227,831 |
| Action « Classic - Distribution » | 49,88 | 45,53 | 45,81 | 331 405,882 |
| Action « I - Capitalisation » | 49,30 | 45,31 | 47,81 | 3 056 447,654 |
| Action « K - Capitalisation » | 99,10 | 89,78 | 93,37 | 514 405,111 |
| Action « N - Capitalisation » | 114,02 | 103,56 | 107,98 | 25 272,826 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 900,63 | 91,85 | 96,77 | 167 194,980 |
| Action « Privilège - Distribution » | 100,71 | 92,44 | 93,55 | 3 579,251 |
| Action « X - Distribution » | 102,81 | 94,84 | 96,45 | 68 206,223 |
| Europe Convertible | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 114 248 020 | 73 791 647 | 62 712 008 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 160,36 | 135,12 | 141,99 | 320 973,996 |
| Action « Classic - Distribution » | 95,97 | 79,98 | 81,69 | 83 107,750 |
| Action « I - Capitalisation » | 190,86 | 162,12 | 171,76 | 47 493,646 |
| Action « I - Distribution » | 105,62 | 0 | 0 | 0 |
| Action « N - Capitalisation » | 100,42 | 84,10 | 87,86 | 755,264 |
| Action « N - Distribution » | 136,84 | 113,36 | 115,08 | 9 836,622 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 126,01 | 106,86 | 113,04 | 5 040,043 |
| Action « Privilège - Distribution » | 114,37 | 95,95 | 98,64 | 4 267,823 |
| Europe Emerging Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 49 489 891 | 19 888 136 | 0 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 118,72 | 48,69 | 0 | 0 |
| Action « Classic - Distribution » | 207,54 | 85,11 | 0 | 0 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 135,04 | 51,97 | 0 | 0 |
| Action « I - Capitalisation » | 141,71 | 58,37 | 0 | 0 |
| Action « N - Capitalisation » | 105,55 | 43,23 | 0 | 0 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 99,13 | 40,78 | 0 | 0 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Europe Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 1 469 359 756 | 1 058 772 591 | 899 313 104 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 291,75 | 257,39 | 288,94 | 1 487 164,151 |
| Action « Classic - Distribution » | 164,15 | 141,18 | 153,80 | 340 189,355 |
| Action « Classic CHF - Capitalisation » | 170,37 | 143,25 | 151,40 | 47 814,009 |
| Action « Classic CHF - Distribution » | 132,66 | 108,71 | 111,49 | 1 195,476 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 331,77 | 274,69 | 319,17 | 9 770,980 |
| Action « I - Capitalisation » | 348,51 | 310,60 | 352,21 | 412 678,155 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 139,89 | 125,23 | 142,65 | 463 325,103 |
| Action « N - Capitalisation » | 203,38 | 178,09 | 198,42 | 37 159,989 |
| Action « N CHF - Capitalisation » | 0 | 0 | 184,46 | 266,860 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 227,30 | 202,36 | 229,22 | 22 103,107 |
| Action « Privilege - Distribution » | 130,38 | 113,15 | 124,39 | 346 077,266 |
| Action « X - Capitalisation » | 247,58 | 222,28 | 253,96 | 549 497,188 |
| Europe Growth | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 343 731 569 | 116 927 579 | 120 234 385 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 65,00 | 55,17 | 61,12 | 335 468,878 |
| Action « Classic - Distribution » | 175,23 | 144,93 | 155,83 | 47 642,650 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 168,93 | 146,51 | 163,20 | 960,000 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 131,49 | 110,66 | 119,64 | 3 554,677 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 170,33 | 148,55 | 168,51 | 1 710,502 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 131,11 | 111,29 | 121,09 | 7 091,497 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 73,91 | 58,88 | 67,52 | 4 257,552 |
| Action « I - Capitalisation » | 264,88 | 227,15 | 254,22 | 116 278,928 |
| Action « N - Capitalisation » | 92,59 | 78,00 | 85,77 | 5 142,929 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 231,57 | 198,35 | 221,74 | 6 187,858 |
| Action « Privilege - Distribution » | 156,97 | 131,02 | 142,16 | 412 150,186 |
| Action « X - Capitalisation » | 129,12 | 111,55 | 125,78 | 5 016,000 |
| Action « X3 - Capitalisation » | 0,01 | 0,01 | 0,01 | 1 000 000,000 |
| Europe High Conviction Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 320 614 658 | 282 162 867 | 309 203 901 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 334,38 | 257,74 | 293,05 | 161 412,063 |
| Action « Classic - Distribution » | 98,61 | 75,96 | 83,45 | 9 359,858 |
| Action « I - Capitalisation » | 100,79 | 78,05 | 89,15 | 119 992,896 |
| Action « I Plus - Capitalisation » | 16 251,17 | 126,15 | 144,44 | 749 449,064 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 340,41 | 263,82 | 301,57 | 470 764,569 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 105,37 | 116,39 | 1 750,697 |
| Europe Real Estate Securities | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 323 447 924 | 198 469 749 | 109 947 398 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 342,66 | 230,28 | 261,04 | 75 310,673 |
| Action « Classic - Distribution » | 166,97 | 109,12 | 117,73 | 138 454,417 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 2 927,95 | 3 129,700 |
| Action « I - Capitalisation » | 414,99 | 281,71 | 322,58 | 111 540,958 |
| Action « N - Capitalisation » | 304,99 | 203,42 | 228,87 | 3 861,169 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 206,81 | 140,24 | 160,41 | 6 949,427 |
| Action « Privilege - Distribution » | 167,57 | 110,51 | 120,32 | 53 657,029 |
| Action « X - Capitalisation » | 235,64 | 161,17 | 185,94 | 117 933,000 |
| Action « X - Distribution » | 104,75 | 69,68 | 76,53 | 88 943,237 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Europe Small Cap | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 168 935 700 | 587 029 423 | 458 079 703 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 288,51 | 223,96 | 242,57 | 748 045,247 |
| Action « Classic - Distribution » | 236,68 | 179,76 | 189,08 | 222 900,114 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 2 721,22 | 1 615,902 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 219,01 | 173,89 | 189,42 | 563,537 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 164,57 | 131,16 | 145,53 | 24 127,886 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 2 700,38 | 12 246,042 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 328,04 | 238,98 | 267,91 | 3 382,763 |
| Action « I - Capitalisation » | 333,14 | 261,62 | 286,68 | 610 388,932 |
| Action « I - Distribution » | 116,14 | 89,25 | 0 | 0 |
| Action « N - Capitalisation » | 260,08 | 200,37 | 215,41 | 34 520,594 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 257,21 | 201,67 | 220,62 | 104 309,736 |
| Action « Privilège - Distribution » | 226,37 | 173,68 | 184,53 | 25 488,653 |
| Action « X - Capitalisation » | 295,64 | 234,14 | 0 | 0 |
| Action « X2 - Capitalisation » | 117 078,32 | 92 717,93 | 102 464,71 | 165,000 |
| Europe Small Cap Convertible | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 350 917 018 | 279 904 404 | 206 579 701 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 191,33 | 172,84 | 179,88 | 608 507,570 |
| Action « Classic - Distribution » | 145,90 | 130,28 | 130,41 | 274 525,010 |
| Action « I - Capitalisation » | 213,45 | 194,40 | 203,97 | 229 242,196 |
| Action « I - Distribution » | 113,69 | 102,35 | 103,29 | 300,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 108,86 | 97,75 | 101,12 | 5 372,033 |
| Action « N - Distribution » | 170,20 | 151,07 | 150,31 | 53 171,192 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 166,90 | 151,77 | 159,00 | 7 626,298 |
| Action « Privilège - Distribution » | 149,73 | 134,58 | 135,60 | 35 275,801 |
| Flexible Global Credit | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 35 555 180 | 22 717 257 | 14 942 534 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 97,18 | 93,04 | 95,19 | 20 624,351 |
| Action « Classic - Distribution » | 95,31 | 91,25 | 91,39 | 4 382,751 |
| Action « X - Distribution » | 100,66 | 96,99 | 97,78 | 128 648,920 |
| Global Absolute Return Multi-Factor Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 15 439 155 | 5 479 083 | 5 691 435 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 90,54 | 81,75 | 84,60 | 10,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 91,25 | 82,70 | 85,88 | 52 553,579 |
| Action « X - Capitalisation » | 91,40 | 82,92 | 86,23 | 13 655,000 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Global Bond Opportunities | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 397 879 981 | 379 256 714 | 360 008 485 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 377,56 | 90,43 | 94,62 | 1 069 357,774 |
| Action « Classic - Distribution » | 207,47 | 80,92 | 82,78 | 1 312 579,857 |
| Action « Classic H USD - Capitalisation » | 431,32 | 380,10 | 404,67 | 19 609,550 |
| Action « Classic USD MD - Distribution » | 0 | 0 | 112,90 | 10,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 415,01 | 360,12 | 379,23 | 233 640,544 |
| Action « K - Capitalisation » | 96,80 | 82,84 | 86,03 | 170 361,104 |
| Action « N - Capitalisation » | 126,25 | 108,31 | 112,76 | 34 789,950 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 130,23 | 80,57 | 84,68 | 24 765,643 |
| Action « Privilege - Distribution » | 101,47 | 83,69 | 86,00 | 38 522,864 |
| Action « X - Capitalisation » | 139,71 | 121,60 | 128,43 | 236 642,077 |
| Global Climate Solutions | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 0 | 28 325 145 | 138 200 460 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 94,16 | 96,82 | 10,000 |
| Action « Classic - Distribution » | 0 | 94,16 | 96,82 | 10,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 0 | 94,28 | 97,91 | 15 321,996 |
| Action « N - Capitalisation » | 0 | 94,05 | 96,00 | 10,000 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 0 | 94,27 | 97,77 | 10,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 94,27 | 97,77 | 10,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 94 398,31 | 98 821,80 | 1 383,252 |
| Global Convertible | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 215 154 444 | 762 551 173 | 554 646 871 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 147,25 | 124,70 | 133,37 | 183 086,426 |
| Action « Classic - Distribution » | 138,63 | 115,75 | 118,72 | 25 323,126 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 133,70 | 112,54 | 119,73 | 12 480,687 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 4 139,87 | 3 620,81 | 3 918,98 | 58 807,557 |
| Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | 203,38 | 168,25 | 175,87 | 802 436,911 |
| Action « Classic RH EUR - Distribution » | 108,18 | 88,23 | 88,45 | 575 358,259 |
| Action « Classic RH PLN - Distribution » | 599,90 | 521,99 | 544,32 | 263,642 |
| Action « I - Capitalisation » | 235,84 | 201,33 | 217,08 | 542 425,730 |
| Action « I RH EUR - Capitalisation » | 231,96 | 193,09 | 203,52 | 724 056,572 |
| Action « I RH NOK - Capitalisation » | 196,91 | 165,62 | 174,84 | 12 290,783 |
| Action « N - Capitalisation » | 132,95 | 111,90 | 118,97 | 35 045,653 |
| Action « N RH EUR - Capitalisation » | 131,42 | 108,03 | 112,21 | 39 381,291 |
| Action « N RH EUR - Distribution » | 123,87 | 100,38 | 99,93 | 11 528,845 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 139,40 | 118,83 | 127,92 | 4 559,188 |
| Action « Privilege RH EUR - Capitalisation » | 152,71 | 127,00 | 133,54 | 35 015,842 |
| Action « Privilege RH EUR - Distribution » | 142,51 | 116,99 | 117,96 | 41 565,423 |
| Action « X - Capitalisation » | 136,30 | 117,05 | 0 | 0 |
| Action « X EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 114,95 | 8 187,845 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Global Enhanced Bond 36M | EUR | | | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 11 149 242 | 50 942 360 | 160 886 376 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 98,48 | 98,59 | 104,58 | 435 388,268 |
| Action « Classic - Distribution » | 98,48 | 98,60 | 102,66 | 56 801,026 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 99,40 | 105,07 | 115,79 | 1 167 575,515 |
| Action « I - Capitalisation » | 98,83 | 99,55 | 106,25 | 83 267,088 |
| Action « N - Capitalisation » | 98,29 | 98,05 | 103,78 | 4 753,285 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 98,71 | 99,22 | 105,81 | 6 272,280 |
| Action « Privilège - Distribution » | 98,71 | 99,22 | 103,85 | 5 519,832 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 102 246,16 | 109 592,27 | 852,890 |

| Global Environment | EUR | | | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 4 090 082 676 | 2 936 533 764 | 2 251 312 313 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B USD - Capitalisation » | 0 | 82,48 | 93,91 | 10,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 324,77 | 263,52 | 292,83 | 2 006 735,738 |
| Action « Classic - Distribution » | 234,75 | 187,17 | 203,88 | 485 008,775 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 144,59 | 111,21 | 124,90 | 386 791,343 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 0 | 90,40 | 103,66 | 10,000 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 3 284,80 | 138 104,108 |
| Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | 0 | 996,75 | 1 072,66 | 670,123 |
| Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | 0 | 91,34 | 98,56 | 100,000 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 162,42 | 128,19 | 138,20 | 168 868,336 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 163,63 | 129,67 | 140,40 | 199 611,654 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 3 259,62 | 39 885,513 |
| Action « Classic SGD - Capitalisation » | 158,95 | 120,42 | 136,21 | 127 575,025 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 369,36 | 281,27 | 323,48 | 173 825,222 |
| Action « I - Capitalisation » | 375,02 | 307,85 | 346,07 | 980 278,966 |
| Action « I Plus H JPY - Capitalisation » | 13 705,00 | 10 698,00 | 11 782,00 | 3 661 980,722 |
| Action « I Plus JPY - Capitalisation » | 14 916,00 | 13 206,00 | 16 468,00 | 4 576 242,559 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 165,84 | 127,76 | 148,66 | 126 084,637 |
| Action « K - Capitalisation » | 127,83 | 102,95 | 113,54 | 440 487,457 |
| Action « N - Capitalisation » | 294,74 | 237,37 | 261,78 | 102 712,644 |
| Action « N - Distribution » | 152,08 | 120,35 | 130,10 | 11 265,100 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 295,46 | 242,15 | 271,77 | 202 977,116 |
| Action « Privilège - Distribution » | 157,04 | 126,49 | 139,17 | 51 023,383 |
| Action « Privilège GBP - Distribution » | 149,15 | 126,94 | 136,38 | 295,000 |
| Action « Privilège USD - Capitalisation » | 164,22 | 126,31 | 146,73 | 18 425,358 |
| Action « UI13 RH USD - Capitalisation » | 0 | 96,41 | 110,99 | 25 840,037 |
| Action « X - Capitalisation » | 239,21 | 197,38 | 223,00 | 404 307,745 |
| Action « X - Distribution » | 119 381,01 | 96 806,11 | 107 223,30 | 65,501 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Global High Yield Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 103 110 844 | 83 196 922 | 79 010 889 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « BH AUD MD - Distribution » | 95,90 | 74,84 | 75,26 | 1 061,478 |
| Action « BH USD MD - Distribution » | 95,92 | 75,86 | 77,16 | 6 203,606 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 110,13 | 95,45 | 104,93 | 60 200,627 |
| Action « Classic - Distribution » | 26,92 | 22,41 | 23,27 | 294 862,049 |
| Action « Classic H AUD MD - Distribution » | 71,29 | 56,18 | 57,12 | 42 152,615 |
| Action « Classic H CZK - Capitalisation » | 11 560,30 | 10 596,54 | 12 076,35 | 19 071,114 |
| Action « Classic H USD - Capitalisation » | 131,91 | 116,93 | 131,42 | 44 010,189 |
| Action « Classic H USD - Distribution » | 38,41 | 32,78 | 34,83 | 14 348,080 |
| Action « Classic H USD MD - Distribution » | 73,44 | 58,78 | 60,36 | 61 203,646 |
| Action « Classic USD MD - Distribution » | 59,13 | 43,18 | 46,03 | 222 430,065 |
| Action « I - Capitalisation » | 125,66 | 109,83 | 121,76 | 34 321,560 |
| Action « IH USD - Capitalisation » | 215,87 | 193,02 | 218,76 | 300,000 |
| Action « K - Capitalisation » | 101,06 | 86,93 | 94,85 | 101 147,911 |
| Action « N - Capitalisation » | 105,71 | 91,16 | 99,70 | 564,917 |
| Action « N - Distribution » | 81,76 | 67,71 | 69,96 | 14 146,214 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 127,27 | 111,08 | 122,96 | 617,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 87,14 | 73,06 | 76,40 | 117 890,869 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 0 | 107 658,39 | 114,000 |
| Global Inflation-Linked Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 580 181 494 | 424 411 842 | 507 819 467 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 167,22 | 135,98 | 136,87 | 318 027,394 |
| Action « Classic - Distribution » | 152,41 | 123,41 | 122,11 | 66 696,458 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 151,17 | 11 645,126 |
| Action « I - Capitalisation » | 183,50 | 150,08 | 151,90 | 226 682,633 |
| Action « N - Capitalisation » | 155,14 | 125,53 | 125,71 | 49 070,486 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 142,35 | 116,22 | 117,24 | 0,243 |
| Action « Privilege - Distribution » | 122,93 | 100,37 | 0 | 0 |
| Action « UI10 H SGD - Capitalisation » | 189,67 | 158,43 | 161,89 | 3 646 078,904 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 0 | 101 851,31 | 87,000 |
| Green Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 096 405 657 | 1 322 734 757 | 1 407 462 750 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 101,06 | 82,77 | 88,02 | 1 338 686,038 |
| Action « Classic - Distribution » | 97,19 | 79,05 | 81,38 | 182 272,400 |
| Action « I - Capitalisation » | 103,25 | 84,97 | 90,86 | 3 171 247,711 |
| Action « K - Capitalisation » | 95,52 | 77,64 | 82,03 | 294 186,592 |
| Action « N - Capitalisation » | 99,07 | 80,73 | 85,52 | 41 679,319 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 102,12 | 83,84 | 89,48 | 354 454,442 |
| Action « Privilege - Distribution » | 98,17 | 80,05 | 82,69 | 457 138,036 |
| Action « X - Capitalisation » | 104,24 | 85 976,38 | 92 167,86 | 3 297,809 |
| Action « X - Distribution » | 101,22 | 82 921,94 | 86 054,20 | 6 779,306 |
| Action « XH AUD QD - Distribution » | 98 974,78 | 82 014,99 | 85 672,78 | 39,840 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Green Tigers | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 974 811 613 | 1 257 612 379 | 882 779 626 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 158,76 | 118,33 | 116,97 | 70 489,734 |
| Action « Classic - Distribution » | 140,62 | 102,19 | 98,20 | 1 729,017 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 306,55 | 243,45 | 232,49 | 1 592 405,352 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 229,41 | 177,75 | 165,00 | 122 261,473 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 102,20 | 80,49 | 81,08 | 341 162,415 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 0 | 96,96 | 95,83 | 2 744,513 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 0 | 100,31 | 97,09 | 10,000 |
| Action « Classic RH CNH - Capitalisation » | 989,58 | 735,84 | 704,96 | 5 265,218 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 102,35 | 75,58 | 73,14 | 2 695,727 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 100,60 | 70,30 | 67,18 | 4 804,746 |
| Action « I - Capitalisation » | 259,05 | 195,23 | 195,14 | 154 851,188 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 106,24 | 85,32 | 82,38 | 164 536,457 |
| Action « N - Capitalisation » | 199,64 | 147,68 | 144,88 | 1 157,405 |
| Action « N EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 131,14 | 25 082,454 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 128,50 | 96,74 | 96,58 | 107 677,520 |
| Action « Privilege - Distribution » | 98,34 | 72,15 | 70,09 | 87 223,172 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 224,52 | 180,10 | 173,73 | 653 831,921 |
| Action « Privilege EUR - Distribution » | 184,64 | 144,52 | 135,51 | 65 025,060 |
| Action « Privilege RH EUR - Capitalisation » | 101,99 | 74,63 | 72,55 | 6 899,201 |
| Action « Privilege RH EUR - Distribution » | 100,07 | 71,38 | 67,49 | 11 202,023 |
| Action « U2 - Capitalisation » | 104,19 | 77,85 | 77,14 | 55 365,998 |
| Action « U2 - Distribution » | 103,01 | 75,01 | 72,31 | 3 950,000 |
| Action « U2 RH GBP - Distribution » | 100,73 | 71,76 | 68,32 | 6 000,000 |
| Action « U2 RH SGD - Capitalisation » | 104,79 | 77,59 | 75,28 | 6 910,888 |
| Action « U2 RH SGD - Distribution » | 104,17 | 0 | 0 | 0 |
| Action « U114 - Capitalisation » | 0 | 0 | 103,46 | 3 427,198 |
| Action « X - Capitalisation » | 16 484,82 | 12 494,50 | 0 | 0 |
| Action « X EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 11 367,38 | 16 220,025 |
| | | | | |
| Harmony | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 210 701 320 | 117 047 976 | 0 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 104,24 | 91,31 | 0 | 0 |
| Action « Classic - Distribution » | 95,99 | 81,80 | 0 | 0 |
| Action « I - Capitalisation » | 114,15 | 100,63 | 0 | 0 |
| Action « K - Capitalisation » | 100,20 | 87,11 | 0 | 0 |
| Action « U3 - Capitalisation » | 98,74 | 86,79 | 0 | 0 |
| | | | | |
| Health Care Innovators | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 324 608 618 | 1 553 311 195 | 1 473 245 274 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 1 515,25 | 1 531,73 | 1 536,22 | 696 391,615 |
| Action « Classic - Distribution » | 996,48 | 993,25 | 979,90 | 87 957,803 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 118,10 | 111,45 | 112,49 | 908 714,904 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 17 101,52 | 714,888 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 345,57 | 327,85 | 340,33 | 53 526,413 |
| Action « I - Capitalisation » | 1 747,53 | 1 784,55 | 1 807,99 | 51 933,827 |
| Action « K - Capitalisation » | 115,53 | 115,91 | 115,38 | 409 993,845 |
| Action « N - Capitalisation » | 400,26 | 401,59 | 399,76 | 30 012,943 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 321,96 | 328,41 | 332,35 | 92 425,230 |
| Action « Privilege - Distribution » | 236,34 | 237,72 | 236,65 | 7 932,057 |
| Action « X - Capitalisation » | 125,99 | 129,61 | 132,31 | 88 018,990 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Japan Small Cap | JPY | JPY | JPY | Nombre d'actions |
|--|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 123 386 423 048 | 90 103 861 002 | 97 849 987 012 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 15 413,00 | 13 597,00 | 16 686,00 | 172 431,387 |
| Action « Classic - Distribution » | 10 608,00 | 9 148,00 | 10 969,00 | 39 610,547 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 117,68 | 96,54 | 107,13 | 369 393,083 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 0 | 0 | 70,42 | 2 752,566 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 208,71 | 183,72 | 232,24 | 237 312,623 |
| Action « Classic H USD - Capitalisation » | 260,81 | 235,01 | 304,17 | 54 866,839 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 118,34 | 205,130 |
| Action « I - Capitalisation » | 18 730,00 | 16 716,00 | 20 753,00 | 3 018 159,174 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 133,27 | 77,076 |
| Action « IH USD - Capitalisation » | 208,63 | 190,22 | 249,40 | 840,529 |
| Action « N - Capitalisation » | 13 074,00 | 11 447,00 | 13 942,00 | 18 652,622 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 415 009,00 | 369 784,00 | 458 516,00 | 12 555,037 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 136,84 | 113,38 | 127,12 | 128 210,309 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 232,58 | 206,72 | 263,81 | 136 365,374 |
| Action « Privilege H USD - Capitalisation » | 172,61 | 157,16 | 205,31 | 19 872,958 |
| Action « X - Capitalisation » | 22 118,00 | 19 881,00 | 24 848,00 | 190,000 |
| Latin America Equity | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 41 785 543 | 43 846 596 | 48 389 643 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 441,77 | 457,05 | 569,09 | 50 267,873 |
| Action « Classic - Distribution » | 241,33 | 243,59 | 281,07 | 7 275,466 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 388,44 | 428,20 | 515,10 | 9 604,823 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 0 | 0 | 254,44 | 2 065,024 |
| Action « I - Capitalisation » | 29,43 | 30,79 | 38,76 | 40 433,792 |
| Action « N - Capitalisation » | 378,46 | 388,62 | 480,26 | 2 818,562 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 26,11 | 27,29 | 34,32 | 254 898,964 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 31,07 | 685,250 |
| Local Emerging Bond | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 284 513 677 | 228 154 861 | 209 525 026 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B MD - Distribution » | 88,21 | 67,01 | 67,25 | 1 419,731 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 124,39 | 109,67 | 123,84 | 106 223,291 |
| Action « Classic - Distribution » | 48,66 | 40,05 | 42,07 | 298 023,977 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 95,58 | 89,79 | 97,96 | 38 923,596 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 50,06 | 44,04 | 44,61 | 243 185,316 |
| Action « Classic GBP - Distribution » | 0 | 0 | 33,00 | 144,425 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 34,92 | 26,89 | 27,30 | 347 965,415 |
| Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | 73,91 | 63,17 | 69,73 | 13 396,269 |
| Action « Classic RH EUR - Distribution » | 36,87 | 29,46 | 30,14 | 18 890,630 |
| Action « I - Capitalisation » | 146,82 | 130,73 | 149,10 | 698 563,415 |
| Action « I RH EUR - Capitalisation » | 93,93 | 81,38 | 90,59 | 403 483,340 |
| Action « N - Capitalisation » | 77,89 | 68,33 | 76,77 | 95 003,488 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 76,05 | 67,60 | 76,95 | 6 088,123 |
| Action « Privilege - Distribution » | 46,44 | 38,55 | 40,83 | 4 019,018 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 96,45 | 91,32 | 100,43 | 27 189,363 |
| Action « Privilege RH EUR - Capitalisation » | 75,88 | 65,45 | 72,62 | 7 432,262 |
| Action « X - Capitalisation » | 92 737,83 | 83 070,76 | 0 | 0 |
| Action « X EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 104 191,36 | 2,650 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Multi-Asset Opportunities | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 68 565 134 | 22 859 972 | 12 134 470 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B MD - Distribution » | 93,34 | 63,16 | 60,13 | 10,000 |
| Action « B RH AUD MD - Distribution » | 92,92 | 61,19 | 57,31 | 100,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 113,48 | 86,33 | 87,69 | 57 025,316 |
| Action « Classic - Distribution » | 82,59 | 57,11 | 55,16 | 634,368 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 112,84 | 91,47 | 89,76 | 14 582,892 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 82,10 | 60,76 | 56,61 | 10 299,845 |
| Action « Classic HKD MD - Distribution » | 76,58 | 52,47 | 50,52 | 22 580,000 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 76,15 | 52,06 | 50,18 | 36 151,486 |
| Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | 75,74 | 50,61 | 47,92 | 11 659,780 |
| Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | 77,15 | 50,40 | 47,51 | 245 003,185 |
| Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | 87,32 | 64,58 | 63,99 | 3 935,895 |
| Action « Classic RH EUR - Distribution » | 66,17 | 44,42 | 41,77 | 3 984,850 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 77,70 | 52,62 | 50,34 | 11 334,768 |
| Action « I - Capitalisation » | 119,81 | 0 | 0 | 0 |
| Action « I RH EUR - Capitalisation » | 89,13 | 66,41 | 66,32 | 1 711,052 |
| Action « Privilege RH EUR - Capitalisation » | 101,29 | 75,25 | 75,08 | 100,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 122,65 | 94,66 | 0 | 0 |
| Multi-Asset Thematic | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 217 781 977 | 223 466 161 | 160 070 572 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 105,40 | 87,54 | 90,64 | 1 145 000,598 |
| Action « Classic - Distribution » | 102,49 | 83,38 | 84,64 | 52 459,842 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 98,61 | 80,78 | 82,05 | 322 934,153 |
| Action « Classic RH AUD - Capitalisation » | 0 | 93,66 | 97,30 | 387,776 |
| Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | 98,76 | 80,82 | 81,19 | 35 939,091 |
| Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | 98,63 | 81,84 | 83,67 | 5 801,242 |
| Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | 0 | 947,60 | 958,48 | 1 093,726 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 1 004,92 | 882,82 | 946,97 | 13 292,175 |
| Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | 98,70 | 81,91 | 83,17 | 71 190,512 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 99,08 | 84,00 | 87,61 | 3 831,728 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 98,65 | 81,78 | 83,07 | 27 138,388 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 99,03 | 84,28 | 89,53 | 18 376,241 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 98,71 | 82,36 | 83,92 | 82 255,536 |
| Action « I - Capitalisation » | 105,96 | 88,72 | 92,64 | 122 174,593 |
| Action « N - Capitalisation » | 101,54 | 83,69 | 86,02 | 11 186,715 |
| Action « Privilege RH USD - Capitalisation » | 0 | 95,76 | 102,30 | 350,270 |
| Action « Privilege RH USD MD - Distribution » | 98,94 | 83,19 | 85,37 | 367,818 |
| Nordic Small Cap | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 316 107 919 | 191 677 843 | 135 236 159 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 666,93 | 445,49 | 454,86 | 136 678,432 |
| Action « Classic - Distribution » | 574,05 | 375,26 | 372,04 | 32 685,487 |
| Action « Classic H NOK - Distribution » | 2 036,43 | 1 414,50 | 1 423,43 | 291 153,142 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 5 102,33 | 2 438,699 |
| Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | 0 | 869,43 | 916,87 | 17 266,333 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 5 063,09 | 713,159 |
| Action « I - Capitalisation » | 79,58 | 53,78 | 55,55 | 130 482,705 |
| Action « N - Capitalisation » | 320,47 | 212,46 | 215,31 | 18 658,668 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 368,27 | 248,48 | 256,26 | 41 456,685 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| SMaRT Food | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 724 156 722 | 1 653 018 572 | 1 094 512 943 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 141,87 | 126,07 | 119,29 | 3 809 477,384 |
| Action « Classic - Distribution » | 124,57 | 108,92 | 100,88 | 165 477,091 |
| Action « Classic CHF - Capitalisation » | 0 | 0 | 100,76 | 10,000 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 131,79 | 113,34 | 108,05 | 165 720,516 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 151,07 | 136,99 | 132,59 | 68 088,333 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 117,27 | 103,08 | 95,26 | 12 868,778 |
| Action « Classic SGD - Capitalisation » | 99,90 | 82,89 | 79,84 | 2 934,123 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 129,99 | 108,41 | 106,18 | 62 318,353 |
| Action « I - Capitalisation » | 153,28 | 137,80 | 131,92 | 1 994 217,398 |
| Action « I MD - Distribution » | 0 | 0 | 91,52 | 58 107,303 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 94,34 | 7 500,000 |
| Action « K - Capitalisation » | 0 | 89,71 | 84,25 | 225 323,314 |
| Action « N - Capitalisation » | 136,24 | 120,16 | 112,85 | 113 586,840 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 151,98 | 136,55 | 130,64 | 405 316,682 |
| Action « Privilege - Distribution » | 135,12 | 119,47 | 111,87 | 66 126,085 |
| Action « Privilege CHF - Capitalisation » | 0 | 0 | 100,83 | 10,000 |
| Action « Privilege GBP - Capitalisation » | 100,07 | 95,00 | 88,76 | 19 600,215 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 102,16 | 88,79 | 85,59 | 14 600,000 |
| Action « Privilege H USD - Capitalisation » | 128,59 | 115,25 | 113,76 | 22 067,999 |
| Action « U - Capitalisation » | 122,97 | 109,83 | 104,44 | 237 648,184 |
| Action « U - Distribution » | 120,96 | 106,30 | 98,94 | 15 491,266 |
| Action « U RH CHF - Capitalisation » | 123,04 | 109,63 | 102,07 | 36 146,183 |
| Action « U RH CHF - Distribution » | 120,19 | 105,33 | 95,97 | 2 804,000 |
| Action « U RH GBP - Capitalisation » | 122,70 | 110,58 | 106,60 | 1 045,000 |
| Action « U RH GBP - Distribution » | 121,69 | 107,94 | 101,84 | 100,000 |
| Action « U RH USD - Capitalisation » | 125,34 | 114,21 | 110,96 | 187 090,595 |
| Action « U RH USD - Distribution » | 123,62 | 110,89 | 105,55 | 100,000 |
| Action « U11 H EUR - Capitalisation » | 99,55 | 85,75 | 81,81 | 14 068,394 |
| Action « UP - Capitalisation » | 125,02 | 112,61 | 108,00 | 548 981,626 |
| Action « UP - Distribution » | 122,96 | 108,99 | 102,32 | 35 910,359 |
| Action « UP RH CHF - Capitalisation » | 124,31 | 111,69 | 104,91 | 326 826,369 |
| Action « UP RH CHF - Distribution » | 122,82 | 108,55 | 99,78 | 43 702,223 |
| Action « UP RH GBP - Capitalisation » | 124,36 | 112,97 | 109,80 | 155 785,560 |
| Action « UP RH GBP - Distribution » | 123,42 | 110,36 | 105,02 | 30 501,340 |
| Action « UP RH USD - Capitalisation » | 127,12 | 116,63 | 114,40 | 345 836,840 |
| Action « UP RH USD - Distribution » | 124,83 | 112,87 | 108,35 | 16 781,104 |
| Action « X - Capitalisation » | 160,63 | 145,17 | 139,69 | 51 506,064 |
| Social Bond | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 127 688 877 | 268 725 827 | 198 210 535 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 99,84 | 89,22 | 94,88 | 1 275,000 |
| Action « Classic - Distribution » | 99,84 | 89,22 | 93,12 | 10,000 |
| Action « Classic H CHF - Capitalisation » | 0 | 97,37 | 101,33 | 300,000 |
| Action « Classic H USD - Capitalisation » | 0 | 98,64 | 107,04 | 300,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 99,69 | 89,37 | 95,31 | 393 685,237 |
| Action « I - Distribution » | 99,69 | 89,36 | 93,48 | 177 954,172 |
| Action « IH CHF - Capitalisation » | 0 | 97,47 | 101,76 | 300,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 99,79 | 88,77 | 94,01 | 10,000 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 99,85 | 89,30 | 95,15 | 15 569,503 |
| Action « Privilege - Distribution » | 99,85 | 89,36 | 93,52 | 10,000 |
| Action « Privilege H CHF - Capitalisation » | 0 | 97,34 | 101,58 | 30 493,100 |
| Action « Privilege H USD - Capitalisation » | 0 | 98,74 | 107,37 | 300,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 99 715,43 | 89 564,78 | 95 694,72 | 1 452,446 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Sustainable Euro Multi-Factor Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 110 208 590 | 61 940 547 | 25 008 033 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 116,64 | 100,29 | 119,76 | 1 175,666 |
| Action « I - Capitalisation » | 119,67 | 103,79 | 125,02 | 136 592,085 |
| Action « X - Capitalisation » | 120 356,74 | 104 794,38 | 126 735,48 | 61,468 |
| Sustainable Europe Dividend | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 195 960 870 | 135 946 781 | 134 760 176 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 111,58 | 99,23 | 113,76 | 312 094,726 |
| Action « Classic - Distribution » | 48,22 | 41,84 | 46,54 | 97 703,478 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 94,07 | 82,94 | 92,53 | 8 067,107 |
| Action « I - Capitalisation » | 134,82 | 121,13 | 140,27 | 186 575,098 |
| Action « N - Capitalisation » | 95,19 | 84,03 | 95,60 | 26 589,052 |
| Action « N - Distribution » | 101,56 | 87,46 | 96,57 | 1 996,774 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 151,90 | 136,32 | 157,68 | 2 960,388 |
| Action « Privilege - Distribution » | 123,11 | 107,79 | 121,02 | 184 901,207 |
| Action « X - Capitalisation » | 155,53 | 140,77 | 164,24 | 257 457,980 |
| Sustainable Europe Multi-Factor Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 368 118 766 | 341 392 755 | 325 041 230 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 157,83 | 139,19 | 164,61 | 252 950,426 |
| Action « Classic - Distribution » | 116,66 | 100,43 | 115,36 | 30 179,811 |
| Action « I - Capitalisation » | 162,66 | 144,69 | 172,61 | 1 271 000,891 |
| Action « K - Capitalisation » | 124,92 | 109,34 | 128,34 | 130 637,493 |
| Action « N - Capitalisation » | 119,89 | 104,42 | 121,95 | 15 807,047 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 130,40 | 115,75 | 137,78 | 34 950,817 |
| Action « Privilege - Distribution » | 116,86 | 101,26 | 117,08 | 1 821,927 |
| Action « X - Capitalisation » | 137,38 | 122,68 | 146,93 | 250 577,957 |
| Sustainable Europe Value | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 515 822 394 | 554 297 646 | 418 975 750 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 182,95 | 168,15 | 191,60 | 1 450 983,643 |
| Action « Classic - Distribution » | 99,53 | 88,31 | 96,28 | 25 419,499 |
| Action « I - Capitalisation » | 220,67 | 204,89 | 235,83 | 89 106,817 |
| Action « I MD - Distribution » | 0 | 0 | 104,41 | 26 582,274 |
| Action « N - Capitalisation » | 159,94 | 145,92 | 165,01 | 7 339,563 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 164,74 | 152,79 | 175,68 | 130 739,175 |
| Action « Privilege - Distribution » | 102,95 | 92,18 | 101,44 | 97,201 |
| Action « X - Capitalisation » | 123,60 | 115,61 | 134,07 | 675 316,000 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Sustainable Global Corporate Bond | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 481 663 417 | 455 948 460 | 380 460 025 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B MD - Distribution » | 97,05 | 77,65 | 77,11 | 72 382,299 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 186,55 | 158,98 | 172,85 | 145 863,510 |
| Action « Classic - Distribution » | 116,81 | 97,52 | 99,48 | 38 845,725 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 0 | 0 | 90,05 | 189,983 |
| Action « Classic H CNH MD - Distribution » | 0 | 922,76 | 911,19 | 300,000 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 116,42 | 96,99 | 103,15 | 138 950,321 |
| Action « Classic HKD - Capitalisation » | 0 | 95,05 | 103,68 | 10,000 |
| Action « Classic HKD MD - Distribution » | 0 | 93,55 | 94,34 | 10,000 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 98,97 | 80,17 | 80,44 | 34 989,930 |
| Action « I - Capitalisation » | 202,04 | 173,28 | 189,61 | 773 609,689 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 171,64 | 5 856,000 |
| Action « IH EUR - Capitalisation » | 120,64 | 101,11 | 108,20 | 1 117 489,096 |
| Action « IH NOK - Capitalisation » | 110,24 | 93,54 | 100,49 | 300,000 |
| Action « K EUR - Capitalisation » | 105,62 | 95,18 | 99,24 | 309 534,172 |
| Action « N - Capitalisation » | 174,64 | 148,08 | 160,20 | 14 386,250 |
| Action « NH EUR - Distribution » | 95,27 | 77,42 | 76,83 | 7 711,305 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 115,36 | 98,75 | 107,85 | 54 347,182 |
| Action « Privilege - Distribution » | 109,02 | 91,42 | 93,72 | 8 231,705 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 118,71 | 108,28 | 114,31 | 4 447,957 |
| Action « Privilege H CHF - Capitalisation » | 99,18 | 82,39 | 86,13 | 300,000 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 117,91 | 98,79 | 105,51 | 13 853,033 |
| Action « X - Capitalisation » | 99 753,47 | 0 | 0 | 0 |
| Action « X - Distribution » | 105,85 | 89,21 | 0 | 0 |
| Sustainable Global Equity | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 475 194 598 | 317 422 642 | 338 663 973 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B - Capitalisation » | 95,60 | 72,48 | 86,01 | 10,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 163,47 | 125,13 | 149,86 | 690 137,138 |
| Action « Classic - Distribution » | 129,81 | 97,61 | 114,54 | 210 261,585 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 187,16 | 152,65 | 176,62 | 421 149,282 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 167,22 | 134,08 | 151,93 | 101 187,683 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 1 521,68 | 20 440,371 |
| Action « Classic RH NOK - Capitalisation » | 159,62 | 119,09 | 139,62 | 24 442,041 |
| Action « I - Capitalisation » | 176,05 | 136,13 | 164,68 | 2 605,304 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 149,08 | 181 344,075 |
| Action « K EUR - Capitalisation » | 109,13 | 88,34 | 101,45 | 155 029,210 |
| Action « Life EUR - Capitalisation » | 188,68 | 155,90 | 182,74 | 36 443,846 |
| Action « N - Capitalisation » | 157,46 | 119,63 | 142,22 | 20 421,547 |
| Action « N EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 128,71 | 19 602,818 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 173,78 | 134,22 | 162,20 | 78 110,138 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 116,61 | 65 659,801 |
| Action « Privilege H NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 1 060,70 | 163 643,244 |
| Action « X - Capitalisation » | 181,70 | 141,54 | 0 | 0 |
| Action « X EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 156,17 | 56 066,317 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Sustainable Global Low Vol Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 905 742 213 | 807 396 642 | 752 773 642 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B USD - Capitalisation » | 110,81 | 92,10 | 102,39 | 2 864,530 |
| Action « B USD MD - Distribution » | 109,61 | 89,55 | 96,67 | 10,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 114,79 | 102,63 | 111,34 | 2 351 862,200 |
| Action « Classic - Distribution » | 103,35 | 91,00 | 96,76 | 252 180,521 |
| Action « Classic CZK - Capitalisation » | 18 288,61 | 15 892,18 | 17 623,64 | 26 577,841 |
| Action « Classic H CZK - Capitalisation » | 1 246,19 | 1 119,95 | 1 282,52 | 15 868,123 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 130,61 | 111,51 | 123,24 | 185 473,763 |
| Action « Classic H USD - Capitalisation » | 0 | 95,95 | 108,70 | 691,797 |
| Action « Classic NOK - Capitalisation » | 0 | 0 | 1 249,10 | 536,327 |
| Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | 0 | 995,26 | 1 042,14 | 100,000 |
| Action « Classic RH HKD - Capitalisation » | 0 | 94,46 | 103,61 | 100,000 |
| Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | 0 | 94,09 | 98,48 | 100,000 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 0 | 94,60 | 104,85 | 100,000 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 0 | 94,27 | 99,04 | 100,000 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 784,64 | 658,32 | 739,28 | 55 558,397 |
| Action « Classic USD - Distribution » | 473,16 | 390,70 | 430,23 | 1 696,788 |
| Action « Classic USD MD - Distribution » | 140,33 | 115,80 | 126,20 | 4 425,874 |
| Action « I - Capitalisation » | 807,27 | 729,05 | 799,02 | 284 605,587 |
| Action « I USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 882,63 | 7 764,535 |
| Action « IH USD - Capitalisation » | 0 | 96,05 | 109,95 | 300,000 |
| Action « K - Capitalisation » | 126,55 | 112,28 | 120,91 | 295 605,261 |
| Action « N - Capitalisation » | 329,15 | 292,06 | 314,50 | 32 906,466 |
| Action « N USD - Capitalisation » | 0 | 0 | 347,44 | 30,426 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 282,13 | 254,51 | 278,62 | 35 381,352 |
| Action « X - Capitalisation » | 156,77 | 142,62 | 157,49 | 309 402,679 |
| Action « X2 - Capitalisation » | 128 195,72 | 116 630,53 | 128 786,96 | 363,000 |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 59 004 192 | 78 625 703 | 59 640 548 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 100,12 | 85,45 | 92,73 | 10,000 |
| Action « Classic - Distribution » | 100,12 | 83,41 | 85,23 | 10,000 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 106,36 | 300,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 100,24 | 86,04 | 93,89 | 10,000 |
| Action « I Plus H EUR - Capitalisation » | 0 | 95,14 | 101,63 | 200 098,000 |
| Action « IH EUR - Capitalisation » | 99,75 | 83,53 | 89,17 | 7 151,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 100,04 | 85,06 | 91,99 | 10,000 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 100,18 | 85,90 | 93,68 | 10,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 100,18 | 83,85 | 86,16 | 10,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 99 939,24 | 85 783,73 | 93 785,26 | 194,000 |
| Action « XH EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 102 546,07 | 161,000 |
| Sustainable Global Multi-Factor Equity | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 13 965 933 | 22 671 529 | 30 055 485 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 186,04 | 160,21 | 181,79 | 301,304 |
| Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | 132,08 | 110,29 | 122,03 | 73 241,518 |
| Action « K EUR - Capitalisation » | 0 | 94,33 | 102,63 | 80 940,074 |
| Action « X - Capitalisation » | 211,12 | 184,09 | 211,52 | 51 775,123 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond

| | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|---|------------|------------|------------|------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 0 | 34 189 490 | 23 442 878 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 98,73 | 110,70 | 10,000 |
| Action « I - Capitalisation » | 0 | 99,12 | 111,89 | 8 153,000 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 0 | 99,00 | 111,51 | 10,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 101,53 | 0 | 0 |
| Action « Privilege H CZK - Capitalisation » | 0 | 0 | 1 121,50 | 378,384 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 99 339,97 | 112 547,07 | 200,000 |

Sustainable Japan Multi-Factor Equity

| | JPY | JPY | JPY | Nombre d'actions |
|---|---------------|---------------|---------------|------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 976 627 843 | 2 047 856 178 | 2 701 967 204 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 1 599,00 | 1 534,00 | 2 062,00 | 35 396,544 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 132,46 | 118,17 | 143,62 | 117 510,588 |
| Action « N - Capitalisation » | 0 | 0 | 11 349,00 | 58,308 |

Sustainable Multi-Asset Balanced

| | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|---------------|---------------|-------------|------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 217 975 721 | 1 273 817 005 | 997 905 510 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 252,70 | 212,90 | 229,97 | 1 888 881,975 |
| Action « Classic - Distribution » | 139,87 | 116,71 | 122,60 | 272 299,919 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 0 | 88,39 | 92,85 | 71 913,704 |
| Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | 109,04 | 88,31 | 91,47 | 600,000 |
| Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | 107,05 | 87,75 | 92,46 | 600,000 |
| Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | 105,46 | 86,20 | 90,21 | 600,000 |
| Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | 100,76 | 86,51 | 93,96 | 100,000 |
| Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | 106,84 | 87,49 | 91,63 | 611,018 |
| Action « Classic RH USD - Capitalisation » | 129,73 | 111,76 | 123,42 | 56 415,784 |
| Action « Classic RH USD - Distribution » | 126,86 | 108,04 | 115,99 | 36 386,049 |
| Action « Classic RH USD MD - Distribution » | 115,01 | 94,86 | 99,76 | 5 601,951 |
| Action « Classic Solidarity BE - Capitalisation » | 122,43 | 103,14 | 111,41 | 820 630,899 |
| Action « Classic Solidarity BE - Distribution » | 117,85 | 98,33 | 103,30 | 993 835,983 |
| Action « I - Capitalisation » | 308,22 | 262,20 | 285,98 | 281 180,955 |
| Action « K - Capitalisation » | 108,25 | 90,52 | 97,04 | 1 219 236,260 |
| Action « N - Capitalisation » | 127,38 | 106,51 | 114,19 | 209 809,908 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 123,51 | 104,85 | 114,11 | 47 310,502 |
| Action « Privilege - Distribution » | 134,91 | 113,42 | 120,04 | 754 134,621 |

Sustainable Multi-Asset Flexible

| | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|------------|------------|------------|------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 0 | 5 531 791 | 94 031 410 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 0 | 99,69 | 102,11 | 284 375,719 |
| Action « Classic - Distribution » | 0 | 99,99 | 102,35 | 39 506,996 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 103,36 | 468 299,968 |
| Action « I - Capitalisation » | 0 | 100,13 | 102,94 | 42 053,228 |
| Action « K - Capitalisation » | 0 | 99,79 | 101,43 | 77 719,706 |
| Action « N - Capitalisation » | 0 | 99,86 | 101,67 | 3 264,490 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 0 | 100,13 | 103,05 | 10,000 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 100,13 | 103,05 | 10,000 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 100 248,00 | 103 633,00 | 0,010 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| Turkey Equity | EUR | EUR | EUR | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 16 810 381 | 68 737 277 | 28 074 914 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 99,43 | 212,33 | 232,27 | 79 504,866 |
| Action « Classic - Distribution » | 62,71 | 131,18 | 141,25 | 14 105,428 |
| Action « Classic USD - Capitalisation » | 33,31 | 66,77 | 75,60 | 6 242,985 |
| Action « I - Capitalisation » | 101,98 | 220,21 | 243,58 | 11 761,832 |
| Action « N - Capitalisation » | 88,38 | 187,34 | 203,40 | 10 413,355 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 51,18 | 110,38 | 121,95 | 13 936,315 |
| Action « Privilège - Distribution » | 35,40 | 74,79 | 81,34 | 6 224,844 |
| | | | | |
| US Growth | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 283 628 261 | 964 733 925 | 1 408 159 717 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 169,86 | 118,57 | 163,23 | 881 976,210 |
| Action « Classic - Distribution » | 91,67 | 63,54 | 86,73 | 299 954,569 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 612,23 | 455,35 | 605,63 | 651 972,678 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 0 | 0 | 78,51 | 393,941 |
| Action « Classic H CZK - Capitalisation » | 584,17 | 415,28 | 576,96 | 1 435 476,374 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 366,23 | 246,70 | 330,97 | 327 347,346 |
| Action « Classic H EUR - Distribution » | 320,25 | 214,31 | 284,95 | 3 896,189 |
| Action « Classic SEK - Capitalisation » | 0 | 0 | 1 644,92 | 442 834,847 |
| Action « I - Capitalisation » | 717,86 | 506,19 | 703,95 | 310 304,954 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 637,26 | 89 778,178 |
| Action « IH EUR - Capitalisation » | 100,09 | 68,06 | 92,23 | 300,000 |
| Action « N - Capitalisation » | 274,20 | 189,97 | 259,57 | 22 415,041 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 416,88 | 293,63 | 407,88 | 197 450,027 |
| Action « Privilège - Distribution » | 211,77 | 148,12 | 204,01 | 10 203,910 |
| Action « Privilège EUR - Capitalisation » | 632,76 | 474,88 | 637,28 | 130 236,829 |
| Action « Privilège H EUR - Capitalisation » | 210,12 | 143,04 | 193,59 | 96 346,267 |
| Action « Privilège H EUR - Distribution » | 191,05 | 129,10 | 173,18 | 1 519,223 |
| Action « X - Capitalisation » | 417,47 | 296,56 | 415,51 | 214 307,026 |
| | | | | |
| US High Yield Bond | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 70 618 763 | 49 358 364 | 44 088 703 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « B MD - Distribution » | 99,93 | 82,72 | 83,63 | 10,000 |
| Action « BH AUD MD - Distribution » | 99,81 | 81,54 | 81,71 | 100,000 |
| Action « Classic - Capitalisation » | 283,71 | 252,61 | 281,67 | 32 809,524 |
| Action « Classic - Distribution » | 97,97 | 82,98 | 85,27 | 12 983,105 |
| Action « Classic H AUD MD - Distribution » | 77,59 | 64,08 | 64,82 | 21 490,758 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 166,24 | 144,64 | 157,86 | 15 953,591 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 64,59 | 54,15 | 55,48 | 380 131,013 |
| Action « I - Capitalisation » | 33,44 | 30,02 | 33,76 | 10 506,816 |
| Action « K EUR - Capitalisation » | 110,16 | 103,73 | 110,91 | 61 474,115 |
| Action « N - Capitalisation » | 255,96 | 226,76 | 251,59 | 4 073,171 |
| Action « Privilège - Capitalisation » | 25,76 | 23,08 | 25,90 | 66,500 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| US Mid Cap | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 149 264 718 | 73 996 490 | 74 181 243 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 336,37 | 282,36 | 329,51 | 117 045,747 |
| Action « Classic - Distribution » | 261,02 | 216,41 | 248,95 | 17 879,835 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 295,75 | 264,54 | 298,27 | 33 324,419 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 0 | 0 | 225,36 | 446,677 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 217,48 | 176,53 | 200,85 | 34 070,884 |
| Action « Classic H SGD - Capitalisation » | 159,04 | 132,35 | 151,57 | 405,276 |
| Action « I - Capitalisation » | 40,33 | 34,25 | 40,44 | 21 689,093 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 148,81 | 134,66 | 153,60 | 37 971,217 |
| Action « N - Capitalisation » | 298,84 | 248,98 | 288,38 | 4 104,255 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 309,61 | 262,52 | 309,44 | 11 081,830 |
| Action « Privilege - Distribution » | 130,16 | 0 | 0 | 0 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 280,11 | 1 543,352 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 170,28 | 139,74 | 160,57 | 308,476 |
| US Small Cap | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 1 144 826 560 | 794 908 960 | 764 760 468 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 369,31 | 295,82 | 343,86 | 256 686,786 |
| Action « Classic - Distribution » | 278,36 | 220,63 | 253,28 | 32 642,493 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 483,21 | 412,44 | 463,18 | 120 721,533 |
| Action « Classic EUR - Distribution » | 244,71 | 206,76 | 229,25 | 10 103,501 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 277,86 | 215,13 | 243,43 | 198 090,247 |
| Action « Classic H SGD - Capitalisation » | 134,28 | 106,56 | 121,43 | 1 877,576 |
| Action « I - Capitalisation » | 451,53 | 365,90 | 430,29 | 974 918,787 |
| Action « I - Distribution » | 0 | 0 | 100,77 | 5 962,000 |
| Action « I EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 109,35 | 159 739,176 |
| Action « IH EUR - Capitalisation » | 146,83 | 115,00 | 131,93 | 96 321,597 |
| Action « N - Capitalisation » | 294,60 | 234,21 | 270,21 | 11 560,858 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 350,62 | 283,67 | 333,06 | 108 157,206 |
| Action « Privilege - Distribution » | 239,42 | 191,68 | 222,27 | 32 770,415 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 169,50 | 146,16 | 165,80 | 71 455,224 |
| Action « Privilege GBP - Capitalisation » | 175,13 | 159,54 | 176,81 | 72,003 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 148,32 | 116,13 | 132,77 | 121 561,231 |
| Action « U16 - Capitalisation » | 0 | 0 | 114,66 | 7 127,217 |
| Action « X - Capitalisation » | 124 526,82 | 0 | 0 | 0 |
| Action « X2 EUR - Capitalisation » | 117 150,79 | 102 006,89 | 116 886,73 | 146,000 |
| USD Money Market | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | 31/12/2023 |
| Actifs nets | 426 524 362 | 725 866 391 | 564 354 467 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 219,051467 | 222,918592 | 234,434698 | 1 964 008,867 |
| Action « Classic - Distribution » | 102,605649 | 104,417129 | 107,913420 | 231 977,521 |
| Action « I - Capitalisation » | 102,045075 | 103,872874 | 109,467342 | 489 351,846 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 1 066,246930 | 1 085,210303 | 1 143,079396 | 20 131,673 |
| Action « Privilege - Distribution » | 0 | 0 | 102,546724 | 22 506,827 |
| Action « U17 - Capitalisation » | 0 | 0 | 10 054,400000 | 0,100 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 101 803,661290 | 0 | 0 |

BNP PARIBAS FUNDS

Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices (Note 9)

| USD Short Duration Bond | USD | USD | USD | Nombre d'actions |
|---|-------------------|-------------------|-------------------|-------------------------|
| | 31/12/2021 | 31/12/2022 | 31/12/2023 | |
| Actifs nets | 137 642 475 | 204 193 866 | 169 502 968 | |
| Valeur nette d'inventaire par action | | | | |
| Action « Classic - Capitalisation » | 485,77 | 464,55 | 485,23 | 96 112,698 |
| Action « Classic - Distribution » | 100,32 | 94,88 | 94,73 | 68 436,264 |
| Action « Classic EUR - Capitalisation » | 100,70 | 102,60 | 103,54 | 63 957,530 |
| Action « Classic H EUR - Capitalisation » | 108,99 | 102,10 | 104,53 | 227 795,198 |
| Action « Classic MD - Distribution » | 115,60 | 109,74 | 108,44 | 550 906,190 |
| Action « I - Capitalisation » | 22,81 | 21,92 | 22,99 | 72 660,836 |
| Action « IH EUR - Capitalisation » | 100,41 | 94,47 | 97,10 | 15 441,084 |
| Action « N - Capitalisation » | 440,14 | 419,44 | 436,59 | 6 355,152 |
| Action « N EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 395,22 | 40,436 |
| Action « Privilege - Capitalisation » | 184,56 | 177,02 | 185,48 | 42 313,300 |
| Action « Privilege - Distribution » | 103,94 | 98,59 | 98,72 | 17 045,000 |
| Action « Privilege EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 167,90 | 39 731,883 |
| Action « Privilege H EUR - Capitalisation » | 0 | 0 | 100,33 | 52,850 |
| Action « X - Capitalisation » | 0 | 100 028,42 | 0 | 0 |

BNP PARIBAS FUNDS Aqua

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 3 680 653 295 | 98,36 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 744 247 | ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC | USD | 94 754 807 | 2,53 | 4 993 836 | CIA SANEAMENTO BASICO DE - ADR | USD | 68 850 878 | 1,84 |
| 775 523 | AECOM | USD | 64 890 772 | 1,73 | 7 463 345 | ALS LTD | AUD | 59 238 702 | 1,58 |
| 1 248 097 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 149 129 881 | 3,99 | 778 497 | STANTEC INC | CAD | 56 856 042 | 1,52 |
| 625 648 | CALIFORNIA WATER SERVICE GRP | USD | 29 377 958 | 0,79 | 2 725 954 | KEMIRA OYJ | EUR | 45 768 768 | 1,22 |
| 125 057 | CHEMED CORP | USD | 66 199 322 | 1,77 | 837 878 | COWAY CO LTD | KRW | 33 717 519 | 0,90 |
| 158 463 | CINTAS CORP | USD | 86 452 099 | 2,31 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 433 052 | ECOLAB INC | USD | 77 758 443 | 2,08 | | | | 3 680 653 295 | 98,36 |
| 514 020 | FRANKLIN ELECTRIC CO INC | USD | 44 973 551 | 1,20 | | | | | |
| 587 417 | IDEX CORP | USD | 115 452 048 | 3,09 | | | | | |
| 92 761 | KLA TENCOR CORP | USD | 48 813 624 | 1,30 | | | | | |
| 1 589 735 | MASCO CORP | USD | 96 392 930 | 2,58 | | | | | |
| 6 361 859 | MUELLER WATER PRODUCTS INC - A | USD | 82 931 942 | 2,22 | | | | | |
| 460 307 | SITEONE LANDSCAPE SUPPLY INC | USD | 67 713 654 | 1,81 | | | | | |
| 1 627 072 | SMITH (A.O.) CORP | USD | 121 428 340 | 3,24 | | | | | |
| 583 464 | TRIMBLE INC | USD | 28 099 656 | 0,75 | | | | | |
| 240 299 | VALMONT INDUSTRIES | USD | 50 796 378 | 1,36 | | | | | |
| 920 180 | VERALTO CORP | USD | 68 523 068 | 1,83 | | | | | |
| 455 717 | WATTS WATER TECHNOLOGIES - A | USD | 85 949 468 | 2,30 | | | | | |
| 828 963 | XYLEM INC | USD | 85 819 227 | 2,29 | | | | | |
| 2 725 216 | ZURN WATER SOLUTIONS CORP | USD | 72 555 653 | 1,94 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 652 333 | FERGUSON PLC | GBP | 113 558 863 | 3,03 | | | | | |
| 329 979 | LINDE PLC | USD | 122 686 530 | 3,28 | | | | | |
| 6 540 824 | PENNON GROUP PLC | GBP | 56 724 127 | 1,52 | | | | | |
| 1 722 842 | PENTAIR PLC | USD | 113 400 481 | 3,03 | | | | | |
| 8 885 418 | POLYPIPE GROUP PLC | GBP | 41 374 025 | 1,11 | | | | | |
| 4 482 971 | SEVERN TRENT PLC | GBP | 133 420 832 | 3,57 | | | | | |
| 616 986 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 74 795 891 | 2,00 | | | | | |
| 9 174 168 | UNITED UTILITIES GROUP PLC | GBP | 112 169 304 | 3,00 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | | | | | |
| 1 613 239 | FISCHER (GEORG)-REG | CHF | 106 022 268 | 2,83 | | | | | |
| 147 104 | GEBERIT AG - REG | CHF | 85 284 561 | 2,28 | | | | | |
| 291 318 | SIKA AG - REG | CHF | 85 762 866 | 2,29 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 5 741 814 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 163 986 209 | 4,37 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | | | | | |
| 2 417 158 | AALBERTS INDUSTRIES NV | EUR | 94 897 623 | 2,54 | | | | | |
| 1 335 743 | ARCADIS NV | EUR | 65 237 688 | 1,74 | | | | | |
| <i>Japon</i> | | | | | | | | | |
| 4 531 118 | KUBOTA CORP | JPY | 61 824 514 | 1,65 | | | | | |
| 1 055 200 | KURITA WATER INDUSTRIES LTD | JPY | 37 463 898 | 1,00 | | | | | |
| 3 743 099 | SEKISUI CHEMICAL CO LTD | JPY | 48 909 301 | 1,31 | | | | | |
| <i>Suède</i> | | | | | | | | | |
| 2 768 770 | ALFA LAVAL AB | SEK | 100 329 829 | 2,68 | | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | | | | | |
| 278 982 | SARTORIUS AG - VORZUG | EUR | 92 956 802 | 2,48 | | | | | |
| <i>Autriche</i> | | | | | | | | | |
| 2 832 293 | WIENERBERGER AG | EUR | 85 591 894 | 2,29 | | | | | |
| <i>Danemark</i> | | | | | | | | | |
| 1 643 397 | NOVOZYMES A/S - B | DKK | 81 811 059 | 2,19 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Asia High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 40 577 046 | 61,64 | | | | | |
| <i>Hong-Kong</i> | | | | | | | | | |
| 200 000 | CHAMPION PATH 4,500% 21-27/01/2026 | USD | 186 633 | 0,28 | 1 100 000 | 10 RENEW PW SUB 4,500% 21-14/07/2028 | USD | 977 460 | 1,49 |
| 400 000 | CHAMPION PATH 4,850% 21-27/01/2028 | USD | 344 000 | 0,52 | 1 125 000 | ADANI GREEN/PR 6,250% 19-10/12/2024 | USD | 1 109 531 | 1,69 |
| 300 000 | CTHY PCFC MTN HK 4,875% 21-17/08/2026 | USD | 293 766 | 0,45 | 175 250 | ADANI RENEW ENER 4,625% 19-15/10/2039 | USD | 136 695 | 0,21 |
| 250 000 | GEMDALE EVER 4,950% 21-12/08/2024 | USD | 153 795 | 0,23 | 200 000 | GMR HYDERABAD IN 4,250% 17-27/10/2027 | USD | 183 070 | 0,28 |
| 500 000 | HENDERSON LAND 2,375% 20-27/05/2025 | USD | 479 012 | 0,73 | 200 000 | GMR HYDERABAD IN 4,750% 21-02/02/2026 | USD | 192 076 | 0,29 |
| 200 000 | HENDERSON LAND 3,875% 19-01/03/2029 | USD | 186 788 | 0,28 | 200 000 | HPCL-MITTAL ENER 5,250% 17-28/04/2027 | USD | 191 063 | 0,29 |
| 200 000 | HOPSON DEVELOP 7,000% 21-18/05/2024 | USD | 179 796 | 0,27 | 400 000 | JSW STEEL LTD 5,050% 21-05/04/2032 | USD | 346 000 | 0,53 |
| 200 000 | HUARONG FINANCE 2019 3,250% 19-13/11/2024 | USD | 193 438 | 0,29 | 550 000 | JSW STEEL LTD 5,375% 19-04/04/2025 | USD | 541 269 | 0,82 |
| 200 000 | HUARONG FINANCE 2019 3,375% 20-24/02/2030 | USD | 165 246 | 0,25 | 101 000 | RENEW POWER 5,875% 20-05/03/2027 | USD | 96 363 | 0,15 |
| 350 000 | HUARONG FINANCE 2019 3,750% 19-29/05/2024 | USD | 344 761 | 0,52 | 500 000 | SHRIRAM TRANSPOR 4,400% 21-13/03/2024 | USD | 495 500 | 0,75 |
| 200 000 | HUARONG FINANCE 2019 4,500% 19-29/05/2029 | USD | 176 813 | 0,27 | <i>Sri Lanka</i> | | | | |
| 1 500 000 | LI & FUNG LTD 5,250% 16-29/12/2049 | USD | 660 000 | 1,00 | 1 075 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,825% 16-18/07/2026 | USD | 548 250 | 0,83 |
| 450 000 | MELCO RESORTS 4,875% 17-06/06/2025 | USD | 437 510 | 0,66 | 1 100 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,850% 15-03/11/2025 | USD | 560 656 | 0,85 |
| 200 000 | MELCO RESORTS 5,250% 19-26/04/2026 | USD | 192 680 | 0,29 | 2 600 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 7,550% 19-28/03/2030 | USD | 1 300 813 | 1,98 |
| 550 000 | MELCO RESORTS 5,375% 19-04/12/2029 | USD | 486 297 | 0,74 | 1 125 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 7,850% 19-14/03/2029 | USD | 562 500 | 0,85 |
| 250 000 | MELCO RESORTS 5,625% 19-17/07/2027 | USD | 235 312 | 0,36 | <i>Iles Vierges britanniques</i> | | | | |
| 600 000 | MELCO RESORTS 5,750% 20-21/07/2028 | USD | 554 949 | 0,84 | 200 000 | CITIC TELECOM IN 6,100% 13-05/03/2025 | USD | 198 000 | 0,30 |
| 352 000 | NWD MTN LTD 4,125% 19-18/07/2029 | USD | 269 472 | 0,41 | 200 000 | EASE TRADE 4,000% 20-10/11/2025 | USD | 184 206 | 0,28 |
| 300 000 | PCPD CAPITAL 5,125% 21-18/06/2026 | USD | 234 720 | 0,36 | 300 000 | FORTUNE STAR 5,000% 21-18/05/2026 | USD | 219 165 | 0,33 |
| 300 000 | RKPF 2019 A LTD 6,000% 20-04/09/2025 | USD | 135 000 | 0,21 | 230 000 | FORTUNE STAR 5,050% 21-27/01/2027 | USD | 150 291 | 0,23 |
| 300 000 | RKPF 2019 A LTD 6,700% 19-30/09/2024 | USD | 235 500 | 0,36 | 200 000 | FORTUNE STAR 5,950% 20-19/10/2025 | USD | 165 870 | 0,25 |
| 400 000 | RKPF OVRS 2020 A 5,125% 21-26/07/2026 | USD | 94 000 | 0,14 | 600 000 | FORTUNE STAR 6,850% 20-02/07/2024 | USD | 575 028 | 0,87 |
| 400 000 | RKPF OVRS 2020 A 5,200% 21-12/01/2026 | USD | 99 280 | 0,15 | 200 000 | HUARONG FINANCE 4,250% 17-07/11/2027 | USD | 181 500 | 0,28 |
| 400 000 | SHIMAO GROUP HOL 5,600% 19-15/07/2026 | USD | 14 000 | 0,02 | 200 000 | HUARONG FINANCE 4,750% 17-27/04/2027 | USD | 186 813 | 0,28 |
| 300 000 | SINO OCEAN LAND 2,700% 21-13/01/2025 | USD | 25 500 | 0,04 | 200 000 | HUARONG FINANCE II 4,625% 16-03/06/2026 | USD | 189 750 | 0,29 |
| 200 000 | SINO OCEAN LAND 3,250% 21-05/05/2026 | USD | 17 000 | 0,03 | 200 000 | HUARONG FINANCE II 5,000% 15-19/11/2025 | USD | 192 938 | 0,29 |
| 500 000 | STUDIO CITY FIN 5,000% 21-15/01/2029 | USD | 418 565 | 0,64 | 200 000 | NEW METRO GLOBAL 4,500% 21-02/05/2026 | USD | 49 190 | 0,07 |
| 600 000 | STUDIO CITY FIN 6,000% 20-15/07/2025 | USD | 589 314 | 0,90 | 450 000 | NEW METRO GLOBAL 4,800% 20-15/12/2024 | USD | 177 750 | 0,27 |
| 450 000 | STUDIO CITY FIN 6,500% 20-15/01/2028 | USD | 416 053 | 0,63 | 500 000 | NWD FINANCE(BVI) 6,250% 19-31/12/2049 | USD | 264 042 | 0,40 |
| 250 000 | WHEELLOCK MTN BVI 2,375% 21-25/01/2026 | USD | 235 421 | 0,36 | 300 000 | SINO OC TR FIN I 6,000% 14-30/07/2024 | USD | 25 500 | 0,04 |
| 650 000 | YANLORD LAND HK 5,125% 21-20/05/2026 | USD | 377 390 | 0,57 | 200 000 | SUN HUNG KAI BVI 5,750% 19-15/11/2024 | USD | 195 575 | 0,30 |
| 200 000 | YANLORD LAND HK 6,800% 19-27/02/2024 | USD | 190 686 | 0,29 | <i>Chine</i> | | | | |
| 750 000 | YUEXIU REIT MTN 2,650% 21-02/02/2026 | USD | 642 984 | 0,98 | 200 000 | CHINA EVERGRANDE 7,500% 17-31/01/2024 | USD | 2 000 | 0,00 |
| <i>Macao</i> | | | 4 904 448 | 7,46 | 600 000 | COUNTRY GARDEN 2,700% 21-12/07/2026 | USD | 46 500 | 0,07 |
| 400 000 | MGM CHINA HOLDIN 4,750% 21-01/02/2027 | USD | 380 506 | 0,58 | 750 000 | COUNTRY GARDEN 3,125% 20-22/10/2025 | USD | 60 000 | 0,09 |
| 650 000 | MGM CHINA HOLDIN 5,250% 20-18/06/2025 | USD | 637 751 | 0,97 | 600 000 | COUNTRY GARDEN 3,3.000% 21-12/01/2031 | USD | 45 000 | 0,07 |
| 1 000 000 | MGM CHINA HOLDIN 5,875% 19-15/05/2026 | USD | 981 452 | 1,49 | 500 000 | COUNTRY GARDEN 4,200% 20-06/02/2026 | USD | 38 750 | 0,06 |
| 250 000 | WYNN MACAU LTD 4,875% 17-01/10/2024 | USD | 247 270 | 0,38 | 600 000 | COUNTRY GARDEN 4,800% 20-06/08/2030 | USD | 45 000 | 0,07 |
| 800 000 | WYNN MACAU LTD 5,125% 19-15/12/2029 | USD | 710 106 | 1,08 | 600 000 | COUNTRY GARDEN 5,125% 18-17/01/2025 | USD | 48 000 | 0,07 |
| 500 000 | WYNN MACAU LTD 5,500% 17-01/10/2027 | USD | 471 615 | 0,72 | 400 000 | COUNTRY GARDEN 5,125% 20-14/01/2027 | USD | 31 000 | 0,05 |
| 800 000 | WYNN MACAU LTD 5,500% 20-15/01/2026 | USD | 779 795 | 1,18 | 200 000 | COUNTRY GARDEN 6,150% 19-17/09/2025 | USD | 16 000 | 0,02 |
| 750 000 | WYNN MACAU LTD 5,625% 20-26/08/2028 | USD | 695 953 | 1,06 | 500 000 | COUNTRY GARDEN 6,500% 19-08/04/2024 | USD | 41 250 | 0,06 |
| | | | | | 700 000 | COUNTRY GARDEN 7,250% 19-08/04/2026 | USD | 54 250 | 0,08 |
| | | | | | 450 000 | COUNTRY GARDEN 8,000% 18-27/01/2024 | USD | 33 750 | 0,05 |

BNP PARIBAS FUNDS Asia High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 985 625 | EASY TACTIC LTD 7,500% 22-11/07/2027 | USD | 46 817 | 0,07 | | <i>Ile Maurice</i> | | <i>1 329 151</i> | <i>2,02</i> |
| 726 250 | EASY TACTIC LTD 7,500% 22-11/07/2028 | USD | 29 050 | 0,04 | 945 000 | GREENKO POWER 4,300% 21-13/12/2028 | USD | 857 588 | 1,30 |
| 500 000 | GREENTOWN CHINA 4,700% 20-29/04/2025 | USD | 430 000 | 0,65 | 250 000 | GREENKO SOLAR 5,950% 19-29/07/2026 | USD | 242 813 | 0,37 |
| 200 000 | KWG GROUP 5,950% 20-10/08/2025 | USD | 10 500 | 0,02 | 250 000 | INDIA GREEN P 4,000% 21-22/02/2027 | USD | 228 750 | 0,35 |
| 400 000 | KWG GROUP 6,000% 21-14/08/2026 | USD | 21 000 | 0,03 | | <i>Mongolie</i> | | <i>1 225 797</i> | <i>1,86</i> |
| 200 000 | KWG GROUP 6,300% 20-13/02/2026 | USD | 10 500 | 0,02 | 200 000 | MONGOLIA 3,500% 21-07/07/2027 | USD | 178 625 | 0,27 |
| 200 000 | KWG GROUP 7,400% 19-05/03/2024 | USD | 10 500 | 0,02 | 650 000 | MONGOLIA 4,450% 21-07/07/2031 | USD | 545 391 | 0,83 |
| 400 000 | KWG GROUP HLDGS LTD 5,875% 17-10/11/2024 | USD | 21 000 | 0,03 | 300 000 | MONGOLIA 5,125% 20-07/04/2026 | USD | 291 281 | 0,44 |
| 600 000 | LENOVO GROUP LTD 5,875% 20-24/04/2025 | USD | 603 168 | 0,92 | 200 000 | MONGOLIA 8,650% 23-19/01/2028 | USD | 210 500 | 0,32 |
| 370 000 | LONGFOR HOLDINGS 3,950% 19-16/09/2029 | USD | 170 200 | 0,26 | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>1 166 691</i> | <i>1,78</i> |
| 600 000 | LONGFOR PROPRTI 4,500% 18-16/01/2028 | USD | 315 000 | 0,48 | 971 250 | GREENKO DUTCH BV 3,850% 21-29/03/2026 | USD | 905 691 | 1,38 |
| 200 000 | POWERLONG 5,950% 20-30/04/2025 | USD | 16 000 | 0,02 | 300 000 | ICTSI TREASURY 3,500% 21-16/11/2031 | USD | 261 000 | 0,40 |
| 200 000 | POWERLONG 6,250% 20-10/08/2024 | USD | 16 688 | 0,03 | | <i>Vietnam</i> | | <i>443 813</i> | <i>0,67</i> |
| 194 000 | POWERLONG 6,950% 23-06/12/2025 | USD | 15 520 | 0,02 | 450 000 | REPUBLIC OF VIETNAM 4,800% 14-19/11/2024 | USD | 443 813 | 0,67 |
| 250 000 | SEAZEN GROUP LTD 4,450% 21-13/07/2025 | USD | 71 563 | 0,11 | | <i>Iles Caimans</i> | | <i>152 250</i> | <i>0,23</i> |
| 300 000 | SHUI ON DEVELOP 5,500% 20-03/03/2025 | USD | 174 180 | 0,26 | 200 000 | AC ENERGY FIN 5,100% 20-31/12/2060 | USD | 152 250 | 0,23 |
| 200 000 | SHUI ON DEVELOP 5,500% 21-29/06/2026 | USD | 96 000 | 0,15 | | Obligations à taux flottant | | 20 340 574 | 30,92 |
| 1 250 000 | TIMES CN HLDG 6,750% 20-08/07/2025 | USD | 15 625 | 0,02 | | <i>Hong-Kong</i> | | <i>7 935 915</i> | <i>12,07</i> |
| | <i>Pakistan</i> | | <i>2 437 734</i> | <i>3,71</i> | 1 100 000 | BANGKOK BANK/HK 19-25/09/2034 FRN | USD | 973 786 | 1,48 |
| 1 600 000 | REPUBLIC OF PAKISTAN 6,000% 21-08/04/2026 | USD | 1 125 500 | 1,71 | 850 000 | BANK OF COMM HK 20-03/09/2171 FRN | USD | 829 213 | 1,26 |
| 1 050 000 | REPUBLIC OF PAKISTAN 7,375% 21-08/04/2031 | USD | 636 234 | 0,97 | 300 000 | BK OF EAST ASIA 19-31/12/2059 FRN | USD | 281 342 | 0,43 |
| 800 000 | REPUBLIC OF PAKISTAN 8,250% 15-30/09/2025 | USD | 676 000 | 1,03 | 350 000 | BK OF EAST ASIA 20-31/12/2060 FRN | USD | 306 409 | 0,47 |
| | <i>Singapour</i> | | <i>2 178 674</i> | <i>3,31</i> | 750 000 | CAS CAPITAL NO1 21-31/12/2061 FRN | USD | 647 051 | 0,98 |
| 750 000 | ABJA INVESTMENT 5,950% 14-31/07/2024 | USD | 746 484 | 1,13 | 500 000 | CELESTIAL 19-31/12/2049 FRN | USD | 498 239 | 0,76 |
| 350 000 | JOLLIBEE WORLDWI 4,750% 20-24/06/2030 | USD | 328 125 | 0,50 | 250 000 | CHONG HING BANK 19-31/12/2059 FRN | USD | 245 703 | 0,37 |
| 255 000 | MEDCO BELL 6,375% 20-30/01/2027 | USD | 244 481 | 0,37 | 250 000 | CMB WING LUNG 19-31/12/2049 FRN | USD | 250 284 | 0,38 |
| 200 000 | SINGAPORE AIR 3,000% 21-20/07/2026 | USD | 190 534 | 0,29 | 500 000 | CN CITIC BK INTL 21-31/12/2061 FRN | USD | 471 500 | 0,72 |
| 300 000 | SINGAPORE AIR 3,375% 22-19/01/2029 | USD | 281 095 | 0,43 | 1 000 000 | DAH SING BANK 23-15/11/2033 FRN | USD | 1 041 905 | 1,58 |
| 200 000 | TML HOLDINGS PTE 4,350% 21-09/06/2026 | USD | 189 813 | 0,29 | 200 000 | FRANSHION BRILLA 21-08/08/2171 FRN | USD | 169 104 | 0,26 |
| 200 000 | TML HOLDINGS PTE 5,500% 20-03/06/2024 | USD | 198 142 | 0,30 | 1 500 000 | HUARONG FINANCE 2019 20-31/12/2060 FRN | USD | 1 393 289 | 2,12 |
| | <i>Philippines</i> | | <i>1 728 821</i> | <i>2,63</i> | 900 000 | KASIKORNBANK PCL 19-02/10/2031 FRN | USD | 828 090 | 1,26 |
| 200 000 | ACEN FINANCE LTD 4,000% 21-31/12/2061 | USD | 125 000 | 0,19 | | <i>Chine</i> | | <i>5 026 529</i> | <i>7,63</i> |
| 200 000 | AYC FINANCE LTD 3,900% 21-31/12/2061 | USD | 124 000 | 0,19 | 1 900 000 | BANK OF COMM HK 20-31/12/2061 FRN | USD | 1 830 530 | 2,78 |
| 200 000 | AYC FINANCE LTD 4,850% 19-31/12/2059 | USD | 151 000 | 0,23 | 3 400 000 | ICBC LTD 21-31/12/2061 FRN | USD | 3 195 999 | 4,85 |
| 200 000 | GLOBE TELECOM 2,500% 20-23/07/2030 | USD | 162 188 | 0,25 | | <i>Inde</i> | | <i>2 266 321</i> | <i>3,45</i> |
| 400 000 | GLOBE TELECOM 3,000% 20-23/07/2035 | USD | 297 000 | 0,45 | 450 000 | AXIS BANK GFT CY 21-08/03/2170 FRN | USD | 408 938 | 0,62 |
| 400 000 | INT CONTAINER 4,750% 20-17/06/2030 | USD | 388 000 | 0,59 | 725 000 | HDFC BANK LTD 21-31/12/2061 FRN | USD | 659 070 | 1,00 |
| 250 000 | MEGAWORLD CORP 4,125% 20-30/07/2027 | USD | 233 125 | 0,35 | 700 000 | NETWORK I2I LTD 19-31/12/2059 FRN | USD | 688 188 | 1,05 |
| 250 000 | SM INVESTMENTS 4,875% 14-10/06/2024 | USD | 248 508 | 0,38 | 550 000 | NETWORK I2I LTD 21-31/12/2061 FRN | USD | 510 125 | 0,78 |
| | <i>Indonésie</i> | | <i>1 634 624</i> | <i>2,48</i> | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>2 101 850</i> | <i>3,20</i> |
| 250 000 | BANK NEGARA INDO 3,750% 21-30/03/2026 | USD | 237 750 | 0,36 | 420 000 | STANDARD CHART 20-31/12/2060 FRN | USD | 415 355 | 0,63 |
| 1 500 000 | PAKUWON JATI 4,875% 21-29/04/2028 | USD | 1 396 874 | 2,12 | 540 000 | STANDARD CHART 21-31/12/2061 FRN | USD | 439 710 | 0,67 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>1 377 687</i> | <i>2,09</i> | 850 000 | STANDARD CHART 21-31/12/2061 FRN | USD | 695 164 | 1,06 |
| 1 400 000 | PERIAMA HOLDINGS 5,950% 20-19/04/2026 | USD | 1 377 687 | 2,09 | 540 000 | STANDARD CHART 22-15/02/2171 FRN | USD | 551 621 | 0,84 |
| | | | | | | <i>Indonésie</i> | | <i>926 953</i> | <i>1,41</i> |
| | | | | | 1 050 000 | BANK NEGARA INDO 21-31/12/2061 FRN | USD | 926 953 | 1,41 |
| | | | | | | <i>Iles Caimans</i> | | <i>915 749</i> | <i>1,39</i> |
| | | | | | 1 020 000 | FWD GROUP LTD 19-13/03/2171 FRN | USD | 915 749 | 1,39 |
| | | | | | | <i>Corée du Sud</i> | | <i>488 125</i> | <i>0,74</i> |
| | | | | | 500 000 | WOORI BANK 19-31/12/2059 FRN | USD | 488 125 | 0,74 |

BNP PARIBAS FUNDS Asia High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Iles Vierges britanniques</i> | | <i>366 804</i> | <i>0,56</i> |
| 200 000 | CNTRL PLAZA DEV 19-31/12/2059 FRN | USD | 178 884 | 0,27 |
| 350 000 | NWD FINANCE(BVI) 21-31/12/2061 FRN | USD | 187 920 | 0,29 |
| | <i>Singapour</i> | | <i>312 328</i> | <i>0,47</i> |
| 800 000 | GLP PTE LTD 21-31/12/2061 FRN | USD | 250 602 | 0,38 |
| 200 000 | GLP PTE LTD 21-31/12/2061 FRN | USD | 61 726 | 0,09 |
| Autres valeurs mobilières | | | 70 000 | 0,11 |
| Obligations | | | 70 000 | 0,11 |
| | <i>Chine</i> | | <i>70 000</i> | <i>0,11</i> |
| 1 000 000 | CHINA SCE GRP 7,000% 20-02/05/2025 DFLT | USD | 57 500 | 0,09 |
| 500 000 | TIMES PROPERTY 6,600% 17-31/12/2049 DFLT | USD | 12 500 | 0,02 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 4 049 805 | 6,14 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>4 049 805</i> | <i>6,14</i> |
| 28 790,27 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D I VNAV - X CAP | USD | 4 049 805 | 6,14 |
| Total portefeuille-titres | | | 65 037 425 | 98,81 |

BNP PARIBAS FUNDS Asia Tech Innovators

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 19 530 610 | 93,39 |
| Actions | | | 19 530 610 | 93,39 |
| <i>Chine</i> | | | <i>6 281 757</i> | <i>30,04</i> |
| 25 500 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | HKD | 246 011 | 1,18 |
| 26 800 | BAIDU INC - A | HKD | 400 295 | 1,91 |
| 11 500 | BYD CO LTD-H | HKD | 317 067 | 1,52 |
| 30 000 | BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | HKD | 140 775 | 0,67 |
| 3 738 000 | CHINA TOWER CORP LTD-H | HKD | 392 878 | 1,88 |
| 356 000 | CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | HKD | 273 390 | 1,31 |
| 10 200 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGICAL A | CNY | 235 097 | 1,12 |
| 133 995 | EAST MONEY INFORMATION CO-A | CNY | 265 687 | 1,27 |
| 127 300 | ESTUN AUTOMATION CO LTD-A | CNY | 333 641 | 1,60 |
| 50 700 | HUNDSUN TECHNOLOGIES INC - A | CNY | 205 710 | 0,98 |
| 78 798 | LUXSHARE PRECISION INDUSTRIAL - A | CNY | 383 046 | 1,83 |
| 22 800 | NETEASE INC | HKD | 411 604 | 1,97 |
| 49 200 | SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGICAL A | CNY | 438 351 | 2,10 |
| 36 000 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 1 359 071 | 6,50 |
| 17 100 | TRIP.COM GROUP LTD | HKD | 613 155 | 2,93 |
| 69 918 | VENUSTECH GROUP INC-A | CNY | 265 979 | 1,27 |
| <i>Corée du Sud</i> | | | <i>4 855 542</i> | <i>23,21</i> |
| 18 902 | COUPANG INC | USD | 306 023 | 1,46 |
| 9 119 | KAKAO CORP | KRW | 384 487 | 1,84 |
| 27 458 | KT CORP | KRW | 733 469 | 3,51 |
| 3 268 | LG ELECTRONICS INC | KRW | 258 255 | 1,23 |
| 846 | LG ENERGY SOLUTION | KRW | 280 881 | 1,34 |
| 29 164 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | KRW | 1 777 168 | 8,50 |
| 778 | SAMSUNG SDI CO LTD | KRW | 285 231 | 1,36 |
| 7 559 | SK HYNIX INC | KRW | 830 028 | 3,97 |
| <i>Taiwan</i> | | | <i>4 350 481</i> | <i>20,81</i> |
| 156 000 | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | TWD | 610 134 | 2,92 |
| 42 000 | DELTA ELECTRONICS INDUSTRIAL CO | TWD | 429 247 | 2,05 |
| 166 000 | NANYA TECHNOLOGY CORPORATION | TWD | 422 053 | 2,02 |
| 25 000 | SILERGY CORP | TWD | 407 347 | 1,95 |
| 107 000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 2 065 225 | 9,88 |
| 7 000 | WIWYNN CORP | TWD | 416 475 | 1,99 |
| <i>Inde</i> | | | <i>2 625 851</i> | <i>12,55</i> |
| 44 440 | MAHINDRA + MAHINDRA-SPON GDR | USD | 937 684 | 4,48 |
| 2 208 | MARUTI SUZUKI INDIA LTD | INR | 273 417 | 1,31 |
| 22 636 | RELIANCE INDUSTRIES - SPONS GDR 144A | USD | 1 414 750 | 6,76 |
| <i>Irlande</i> | | | <i>704 044</i> | <i>3,37</i> |
| 4 812 | PINDUODUO INC - ADR | USD | 704 044 | 3,37 |
| <i>Hong-Kong</i> | | | <i>490 674</i> | <i>2,35</i> |
| 14 300 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | HKD | 490 674 | 2,35 |
| <i>Suisse</i> | | | <i>222 261</i> | <i>1,06</i> |
| 3 955 | ABB INDIA LTD | INR | 222 261 | 1,06 |
| Total portefeuille-titres | | | 19 530 610 | 93,39 |

BNP PARIBAS FUNDS Belgium Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 141 013 096 | 99,73 |
| Actions | | | 141 013 096 | 99,73 |
| <i>Belgique</i> | | | <i>122 761 377</i> | <i>86,82</i> |
| 35 258 | ACKERMANS & VAN HAAREN | EUR | 5 598 970 | 3,96 |
| 78 844 | AEDIFICA | EUR | 5 018 421 | 3,55 |
| 170 667 | AGEAS | EUR | 6 708 920 | 4,74 |
| 234 327 | ANHEUSER - BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 13 689 383 | 9,69 |
| 159 580 | AZELIS GROUP NV | EUR | 3 539 484 | 2,50 |
| 399 734 | BALTA GROUP NV | EUR | 287 808 | 0,20 |
| 186 215 | BARCO N.V. | EUR | 3 081 858 | 2,18 |
| 6 113 | COFINIMMO | EUR | 436 468 | 0,31 |
| 41 916 | DIETEREN SA/NV | EUR | 7 414 940 | 5,24 |
| 29 595 | ELIA SYSTEM OPERATOR SA/NV | EUR | 3 353 114 | 2,37 |
| 93 829 | FINANCIERE DE TUBIZE | EUR | 6 727 539 | 4,76 |
| 56 987 | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | EUR | 4 058 614 | 2,87 |
| 42 819 | INCLUSIO SA | EUR | 560 929 | 0,40 |
| 173 579 | ION BEAM APPLICATIONS | EUR | 2 003 102 | 1,42 |
| 222 194 | KBC GROEP NV | EUR | 13 047 232 | 9,23 |
| 65 951 | KINEPOLIS | EUR | 2 948 010 | 2,08 |
| 788 | LOTUS BAKERIES | EUR | 6 485 240 | 4,59 |
| 45 811 | MELEXIS NV | EUR | 4 180 254 | 2,96 |
| 111 919 | MITHRA PHARMACEUTICALS - W/I | EUR | 140 346 | 0,10 |
| 133 308 | NYXOAH SA | EUR | 567 892 | 0,40 |
| 129 807 | ONTEX GROUP NV - W/I | EUR | 987 182 | 0,70 |
| 182 732 | RECTICEL | EUR | 1 936 959 | 1,37 |
| 156 242 | SOLVAY SA | EUR | 4 332 591 | 3,06 |
| 87 500 | SYENSQO SA | EUR | 8 247 750 | 5,83 |
| 84 925 | UCB SA | EUR | 6 700 583 | 4,74 |
| 155 730 | UMICORE | EUR | 3 877 677 | 2,74 |
| 239 653 | WAREHOUSES DE PAUW SCA | EUR | 6 830 111 | 4,83 |
| <i>Pays-Bas</i> | | | <i>15 447 790</i> | <i>10,93</i> |
| 28 360 | ARGENX SE | EUR | 9 741 660 | 6,89 |
| 395 806 | ING GROEP NV | EUR | 5 353 672 | 3,79 |
| 113 696 | ONWARD MEDICAL | EUR | 352 458 | 0,25 |
| <i>Ile de Guernesey</i> | | | <i>2 803 929</i> | <i>1,98</i> |
| 62 504 | SHURGARD SELF STORAGE LTD | EUR | 2 803 929 | 1,98 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 884 176 | 0,63 |
| <i>Luxembourg</i> | | | <i>884 176</i> | <i>0,63</i> |
| 7 173,76 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 884 176 | 0,63 |
| Total portefeuille-titres | | | 141 897 272 | 100,36 |

BNP PARIBAS FUNDS Brazil Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 78 600 791 | 98,14 |
| Actions | | | 78 600 791 | 98,14 |
| <i>Brésil</i> | | | <i>74 666 879</i> | <i>93,23</i> |
| 296 400 | AMBEV SA | BRL | 837 774 | 1,05 |
| 135 800 | AREZZO INDUSTRIA E COMERCIO | BRL | 1 804 012 | 2,25 |
| 233 800 | AZUL SA | BRL | 770 573 | 0,96 |
| 918 100 | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | BRL | 2 749 990 | 3,43 |
| 299 600 | BANCO DO BRASIL S.A. | BRL | 3 416 263 | 4,27 |
| 491 910 | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | BRL | 3 407 601 | 4,25 |
| 184 700 | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIR | BRL | 1 613 311 | 2,01 |
| 119 903 | CM HOSPITALAR SA | BRL | 344 336 | 0,43 |
| 458 370 | CPFL ENERGIA SA | BRL | 3 633 857 | 4,54 |
| 169 600 | EMBRAER SA | BRL | 781 732 | 0,98 |
| 509 353 | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | BRL | 3 745 488 | 4,68 |
| 316 651 | GERDAU SA - PREF | BRL | 1 548 836 | 1,93 |
| 359 464 | GPS PARTICIPACOES E EMPREEND | BRL | 1 394 906 | 1,74 |
| 1 114 418 | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | BRL | 7 793 306 | 9,73 |
| 1 680 382 | ITAUSA INVESTIMENTOS ITAU-PR | BRL | 3 587 277 | 4,48 |
| 425 118 | LOCALIZA RENT A CAR | BRL | 5 566 019 | 6,95 |
| 217 300 | PETRO RIO SA | BRL | 2 060 001 | 2,57 |
| 977 300 | PETROLEO BRASILEIRO PETROBRAS - PREF | BRL | 7 492 308 | 9,36 |
| 620 000 | RAIA DROGASIL SA | BRL | 3 752 469 | 4,69 |
| 952 200 | RAIZEN SA - PREFERENCE | BRL | 789 971 | 0,99 |
| 125 136 | RANDON PARTICIPACOES SA-PREF | BRL | 329 739 | 0,41 |
| 141 400 | REDE DOR SAO LUIZ SA | BRL | 837 175 | 1,05 |
| 647 500 | RUMO SA | BRL | 3 059 148 | 3,82 |
| 115 700 | TELEFONICA BRASIL S.A. | BRL | 1 272 852 | 1,59 |
| 197 900 | TRACK & FIELD CO S.A | BRL | 612 326 | 0,76 |
| 931 062 | TRES TENTOS AGROINDUSTRIAL | BRL | 2 307 720 | 2,88 |
| 287 300 | VALE SA | BRL | 4 565 948 | 5,70 |
| 188 460 | VALE SA - ADR | USD | 2 988 976 | 3,73 |
| 227 345 | VIVARA PARTICIPACOES SA | BRL | 1 602 965 | 2,00 |
| <i>Iles Caïmans</i> | | | <i>3 933 912</i> | <i>4,91</i> |
| 508 093 | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | BRL | 3 933 912 | 4,91 |
| Autres valeurs mobilières | | | 6 279 | 0,01 |
| Obligations | | | 0 | 0,00 |
| <i>Brésil</i> | | | <i>0</i> | <i>0,00</i> |
| 13 290 | INEPAR SA INDUSTRIA E CONSTRUÇOES 0,000% 25/11/2049 | BRL | 0 | 0,00 |
| Warrants, droits | | | 6 279 | 0,01 |
| 1 525 | LOCALIZA RENT A CAR SA RTS 05/02/2024 | BRL | 6 279 | 0,01 |
| Total portefeuille-titres | | | 78 607 070 | 98,15 |

BNP PARIBAS FUNDS China A-Shares

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| | | | | | 7 002 196 5,59 | | | | |
| | | | | | Luxembourg | | | | |
| | | | | | 49 778,95 BNP PARIBAS INSTICASH USD ID I | | | | |
| | | | | | VNAV - X CAP USD 7 002 196 5,59 | | | | |
| Actions | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 123 089 290 98,27 | | | | |
| 116 087 094 92,68 | | | | | | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | <i>116 087 094 92,68</i> | | | | |
| 1 315 500 | AIR CHINA LTD - A | CNY | 1 362 143 | 1,09 | | | | | |
| 150 000 | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - A | CNY | 477 285 | 0,38 | | | | | |
| 762 750 | BEIJING ORIENTAL YUHONG-A | CNY | 2 066 762 | 1,65 | | | | | |
| 68 900 | BYD CO LTD -A | CNY | 1 926 906 | 1,54 | | | | | |
| 489 100 | CENTRE TESTING INTERNATIONAL GROUP-A | CNY | 979 434 | 0,78 | | | | | |
| 90 800 | CHANGZHOU XINGYU AUTOMOTIV-A | CNY | 1 678 462 | 1,34 | | | | | |
| 1 150 400 | CHINA MERCHANTS BANK-A | CNY | 4 518 450 | 3,61 | | | | | |
| 436 300 | CHINA PACIFIC INSURANCE GR - A | CNY | 1 465 039 | 1,17 | | | | | |
| 3 048 200 | CHINA PETROLEUM + CHEMICAL - A | CNY | 2 399 834 | 1,92 | | | | | |
| 918 400 | CHINA VANKE CO LTD - A | CNY | 1 356 911 | 1,08 | | | | | |
| 1 244 800 | CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | CNY | 4 097 771 | 3,27 | | | | | |
| 1 224 855 | CITIC SECURITIES CO-A | CNY | 3 521 896 | 2,81 | | | | | |
| 162 760 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | CNY | 3 751 408 | 2,99 | | | | | |
| 242 500 | FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP - A | CNY | 1 278 596 | 1,02 | | | | | |
| 262 000 | GLODON SOFTWARE CO LTD - A | CNY | 633 247 | 0,51 | | | | | |
| 649 180 | HONGFA TECHNOLOGY CO LTD - A | CNY | 2 530 339 | 2,02 | | | | | |
| 1 610 600 | HUATAI SECURITIES CO LTD - A | CNY | 3 170 477 | 2,53 | | | | | |
| 508 950 | HUNDSUN TECHNOLOGIES INC - A | CNY | 2 065 015 | 1,65 | | | | | |
| 2 966 900 | IND & COMM BANK OF CHINA - A | CNY | 2 000 153 | 1,60 | | | | | |
| 844 300 | INNER MONGOLIA YILI INDUS-A | CNY | 3 185 917 | 2,54 | | | | | |
| 216 516 | INNOCARE PHARMA LTD-A | CNY | 351 286 | 0,28 | | | | | |
| 167 138 | JIANGSU CNANO TECHNOLOGY C-A | CNY | 684 371 | 0,55 | | | | | |
| 260 948 | JIANGSU HENGLI HIGHPRESSUR-A | CNY | 2 012 260 | 1,61 | | | | | |
| 37 100 | KWEICHOW MOUTAI CO LTD - A | CNY | 9 035 285 | 7,21 | | | | | |
| 56 373 | LEADER HARMONIOUS DRIVE SY - A | CNY | 1 221 157 | 0,97 | | | | | |
| 374 400 | LONGI GREEN ENERGY TECHNOL - A | CNY | 1 209 916 | 0,97 | | | | | |
| 492 670 | LUXSHARE PRECISION INDUSTR - A | CNY | 2 394 927 | 1,91 | | | | | |
| 140 742 | MAXSCEND MICROELECTRONICS - A | CNY | 2 798 404 | 2,23 | | | | | |
| 335 000 | MIDEA GROUP CO LTD - A | CNY | 2 581 319 | 2,06 | | | | | |
| 912 120 | NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | CNY | 2 871 094 | 2,29 | | | | | |
| 123 800 | NINGBO ORIENT WIRES & CABL - A | CNY | 746 461 | 0,60 | | | | | |
| 484 500 | PING AN INSURANCE GROUP CO-A | CNY | 2 757 150 | 2,20 | | | | | |
| 155 736 | PROYA COSMETICS CO LTD-A | CNY | 2 183 545 | 1,74 | | | | | |
| 786 100 | QINGDAO HAIER CO LTD - A | CNY | 2 330 152 | 1,86 | | | | | |
| 359 000 | S F HOLDING CO LTD-A | CNY | 2 048 720 | 1,64 | | | | | |
| 1 113 900 | SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD - A | CNY | 2 163 455 | 1,73 | | | | | |
| 603 900 | SHANDONG SINOCERA FUNCTION - A | CNY | 1 969 023 | 1,57 | | | | | |
| 289 500 | SHANGHAI INTERNATIONAL AIR-A | CNY | 1 338 670 | 1,07 | | | | | |
| 355 500 | SHANGHAI JINJIANG INTERNAT - A | CNY | 1 499 833 | 1,20 | | | | | |
| 109 300 | SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | CNY | 4 482 578 | 3,58 | | | | | |
| 168 900 | SINOSEAL HOLDING CO LTD - A | CNY | 900 197 | 0,72 | | | | | |
| 173 700 | TSINGTAO BREWERY CO LTD - A | CNY | 1 831 602 | 1,46 | | | | | |
| 633 600 | VENUSTECH GROUP INC-A | CNY | 2 410 310 | 1,92 | | | | | |
| 193 415 | WILL SEMICONDUCTOR LTD - A | CNY | 2 912 362 | 2,33 | | | | | |
| 369 200 | WUHU SHUNRONG SANQI INTERA - A | CNY | 980 205 | 0,78 | | | | | |
| 118 000 | WULIANGYE YIBIN CO LTD - A | CNY | 2 337 796 | 1,87 | | | | | |
| 385 940 | WUXI APTEC CO LTD - A | CNY | 3 964 505 | 3,16 | | | | | |
| 432 500 | YONYOU NETWORK TECHNOLOGY - A | CNY | 1 085 313 | 0,87 | | | | | |
| 897 770 | ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN - A | CNY | 3 721 578 | 2,97 | | | | | |
| 207 500 | ZHONGJI INNOLIGHT CO LTD - A | CNY | 3 301 473 | 2,64 | | | | | |
| 291 890 | ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI - A | CNY | 1 495 742 | 1,19 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS China Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|---|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | 808 212 785 96,39 | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | <i>697 765 133 83,22</i> | | | | |
| 8 305 888 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | HKD | 80 130 970 | 9,57 | 113 464 | PINDUODUO INC - ADR | USD | 16 600 918 | 1,98 |
| 1 944 450 | BAIDU INC - A | HKD | 29 043 015 | 3,46 | 369 822 | YUM CHINA HOLDINGS INC | USD | 15 691 547 | 1,87 |
| 60 218 | BEIGENE LTD-ADR | USD | 10 860 918 | 1,30 | 4 732 000 | MGM CHINA HOLDINGS LTD | HKD | 6 010 366 | 0,72 |
| 9 184 000 | BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT - H | HKD | 2 696 141 | 0,32 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 3 558 635 | BEIJING ORIENTAL YUHONG-A | CNY | 9 642 547 | 1,15 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 639 500 | BYD CO LTD-H | HKD | 17 631 668 | 2,10 | 85 321,89 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D I VNAV - X CAP | USD | 12 001 873 | 1,43 |
| 15 338 000 | CATHAY MEDIA AND EDUCATION | HKD | 1 534 271 | 0,18 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 3 026 000 | CHINA MENGNIU DAIRY CO | HKD | 8 158 812 | 0,97 | 820 214 658 97,82 | | | | |
| 6 056 000 | CHINA MERCHANTS BANK -H | HKD | 21 089 386 | 2,52 | | | | | |
| 40 462 000 | CHINA PETROLEUM & CHEMICAL - H | HKD | 21 236 801 | 2,53 | | | | | |
| 5 866 065 | CHINA YANGTZE POWER CO LTD-A | CNY | 19 310 564 | 2,30 | | | | | |
| 15 854 000 | CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | HKD | 12 175 064 | 1,45 | | | | | |
| 525 559 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | CNY | 12 113 457 | 1,44 | | | | | |
| 5 276 500 | GREAT WALL MOTOR COMPANY - H | HKD | 6 865 650 | 0,82 | | | | | |
| 3 373 812 | HONGFA TECHNOLOGY CO LTD - A | CNY | 13 150 262 | 1,57 | | | | | |
| 503 764 | JD.COM INC - CL A | HKD | 7 317 250 | 0,87 | | | | | |
| 1 178 712 | JIANGSU CNANO TECHNOLOGY C-A | CNY | 4 826 406 | 0,58 | | | | | |
| 555 721 | KANZHUN LTD - ADR | USD | 9 230 526 | 1,10 | | | | | |
| 7 760 000 | KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | HKD | 11 342 738 | 1,35 | | | | | |
| 92 519 | KWEICHOW MOUTAI CO LTD - A | CNY | 22 531 955 | 2,69 | | | | | |
| 426 711 | LEADER HARMONIOUS DRIVE SY - A | CNY | 9 243 451 | 1,10 | | | | | |
| 7 420 000 | LENOVO GROUP LTD | HKD | 10 392 751 | 1,24 | | | | | |
| 2 751 500 | LI NING CO LTD | HKD | 7 395 549 | 0,88 | | | | | |
| 3 489 500 | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 5 610 636 | 0,67 | | | | | |
| 551 471 | MAXSCEND MICROELECTRONICS - A | CNY | 10 965 020 | 1,31 | | | | | |
| 752 770 | MEITUAN-CLASS B | HKD | 7 920 565 | 0,94 | | | | | |
| 5 516 000 | MINTH GROUP LTD | HKD | 11 161 650 | 1,33 | | | | | |
| 4 532 689 | NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | CNY | 14 267 616 | 1,70 | | | | | |
| 2 688 545 | NETEASE INC | USD | 49 103 585 | 5,87 | | | | | |
| 320 724 | NEW ORIENTAL EDUCATIO-SP ADR | USD | 23 502 655 | 2,80 | | | | | |
| 4 148 000 | PING AN INSURANCE GROUP CO - H | HKD | 18 785 373 | 2,24 | | | | | |
| 4 390 195 | QINGDAO HAIER CO LTD - A | CNY | 13 013 383 | 1,55 | | | | | |
| 5 255 308 | SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD - A | CNY | 10 207 039 | 1,22 | | | | | |
| 3 399 624 | SHANDONG SINOCERA FUNCTION - A | CNY | 11 084 515 | 1,32 | | | | | |
| 432 119 | SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDIC-A | CNY | 17 721 933 | 2,11 | | | | | |
| 1 991 600 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 75 186 829 | 8,98 | | | | | |
| 491 750 | TRIP.COM GROUP LTD | HKD | 17 632 692 | 2,10 | | | | | |
| 2 710 337 | VENUSTECH GROUP INC-A | CNY | 10 310 530 | 1,23 | | | | | |
| 763 569 | WILL SEMICONDUCTOR LTD - A | CNY | 11 497 503 | 1,37 | | | | | |
| 4 051 000 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | HKD | 15 398 155 | 1,84 | | | | | |
| 9 377 | WUXI XDC CAYMAN INC | HKD | 38 427 | 0,00 | | | | | |
| 4 415 367 | ZHEJIANG SANHUA INTELLIGEN - A | CNY | 18 303 276 | 2,18 | | | | | |
| 1 587 250 | ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRI - A | CNY | 8 133 599 | 0,97 | | | | | |
| <i>Taiwan</i> | | | | | <i>38 571 468 4,60</i> | | | | |
| 1 031 000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 19 899 502 | 2,37 | | | | | |
| 731 000 | UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | TWD | 4 192 081 | 0,50 | | | | | |
| 58 000 | WIWYNN CORP | TWD | 3 450 795 | 0,41 | | | | | |
| 567 062 | YAGEO CORPORATION | TWD | 11 029 090 | 1,32 | | | | | |
| <i>Hong-Kong</i> | | | | | <i>33 573 353 4,00</i> | | | | |
| 1 980 400 | AIA GROUP LTD | HKD | 17 280 649 | 2,06 | | | | | |
| 1 695 000 | GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L | HKD | 9 509 050 | 1,13 | | | | | |
| 197 700 | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | HKD | 6 783 654 | 0,81 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Climate Impact

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | 2 732 843 372 98,01 | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | <i>1 234 546 761 44,29</i> | | | | |
| 383 279 | ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC | USD | 48 797 681 | 1,75 | | | | | |
| 741 488 | ALTAIR ENGINEERING INC - A | USD | 56 485 054 | 2,03 | | | | | |
| 444 296 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 53 087 067 | 1,90 | | | | | |
| 293 751 | BADGER METER INC | USD | 41 050 416 | 1,47 | | | | | |
| 222 872 | CADENCE DESIGN SYS INC | USD | 54 952 833 | 1,97 | | | | | |
| 166 145 | CARLISLE COS INC | USD | 46 991 067 | 1,69 | | | | | |
| 808 810 | CARRIER GLOBAL CORP | USD | 42 064 124 | 1,51 | | | | | |
| 1 090 050 | DARLING INGREDIENTS INC | USD | 49 181 272 | 1,76 | | | | | |
| 472 734 | GENERAC HOLDINGS INC | USD | 55 308 145 | 1,98 | | | | | |
| 166 810 | HUBBELL INC | USD | 49 670 767 | 1,78 | | | | | |
| 104 360 | LENNOX INTERNATIONAL INC | USD | 42 278 719 | 1,52 | | | | | |
| 265 875 | LITTELFUSE INC | USD | 64 398 239 | 2,31 | | | | | |
| 101 429 | MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC | USD | 57 918 241 | 2,08 | | | | | |
| 994 178 | ORMAT TECHNOLOGIES INC | USD | 68 210 520 | 2,45 | | | | | |
| 490 823 | PTC INC | USD | 77 739 005 | 2,78 | | | | | |
| 2 218 304 | RAYONIER INC | USD | 67 092 325 | 2,41 | | | | | |
| 333 253 | REPLIGEN CORP | USD | 54 242 420 | 1,95 | | | | | |
| 336 185 | SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 28 485 870 | 1,02 | | | | | |
| 586 170 | TREX COMPANY INC | USD | 43 931 575 | 1,58 | | | | | |
| 1 205 209 | TRIMBLE INC | USD | 58 042 927 | 2,08 | | | | | |
| 177 452 | VALMONT INDUSTRIES | USD | 37 511 263 | 1,35 | | | | | |
| 997 553 | VERTIV HOLDINGS CO | USD | 43 373 440 | 1,56 | | | | | |
| 254 716 | WATTS WATER TECHNOLOGIES - A | USD | 48 040 132 | 1,72 | | | | | |
| 1 716 270 | ZURN WATER SOLUTIONS CORP | USD | 45 693 659 | 1,64 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | <i>369 248 079 13,23</i> | | | | |
| 858 891 | APTIV PLC | USD | 69 759 381 | 2,50 | | | | | |
| 789 248 | ASHTREAD GROUP PLC | GBP | 49 747 534 | 1,78 | | | | | |
| 736 731 | CRODA INTERNATIONAL PLC | GBP | 42 934 528 | 1,54 | | | | | |
| 2 616 164 | HALMA PLC | GBP | 68 955 266 | 2,47 | | | | | |
| 1 088 915 | PENTAIR PLC | USD | 71 674 295 | 2,57 | | | | | |
| 545 890 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 66 177 075 | 2,37 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | <i>131 474 240 4,72</i> | | | | |
| 571 786 | LEGRAND SA | EUR | 53 805 063 | 1,93 | | | | | |
| 2 719 509 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 77 669 177 | 2,79 | | | | | |
| <i>Danemark</i> | | | | | <i>117 804 946 4,23</i> | | | | |
| 608 429 | CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | DKK | 46 212 380 | 1,66 | | | | | |
| 2 490 389 | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | DKK | 71 592 566 | 2,57 | | | | | |
| <i>Japon</i> | | | | | <i>108 614 136 3,89</i> | | | | |
| 1 720 400 | AZBIL CORP | JPY | 51 633 882 | 1,85 | | | | | |
| 406 700 | SHIMANO INC | JPY | 56 980 254 | 2,04 | | | | | |
| <i>Italie</i> | | | | | <i>79 661 257 2,86</i> | | | | |
| 367 790 | DIASORIN SPA | EUR | 34 292 740 | 1,23 | | | | | |
| 1 101 980 | PRYSMIAN SPA | EUR | 45 368 517 | 1,63 | | | | | |
| <i>Taiwan</i> | | | | | <i>79 428 054 2,84</i> | | | | |
| 8 585 000 | DELTA ELECTRONICS INDUSTRIAL CO | TWD | 79 428 054 | 2,84 | | | | | |
| <i>Canada</i> | | | | | <i>74 322 345 2,67</i> | | | | |
| 3 214 309 | BORALEX INC -A | CAD | 74 322 345 | 2,67 | | | | | |
| <i>Espagne</i> | | | | | <i>73 008 748 2,62</i> | | | | |
| 3 941 093 | EDP RENOVAVEIS SA | EUR | 73 008 748 | 2,62 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | <i>65 224 228 2,34</i> | | | | |
| 708 959 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 65 224 228 | 2,34 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres 2 732 843 372 98,01 | | | | |
| | | | | | <i>Pays-Bas</i> 63 279 871 2,27 2 087 067 SIGNIFY NV EUR 63 279 871 2,27 <i>Australie</i> 55 905 174 2,00 6 654 771 BRAMBLES LTD AUD 55 905 174 2,00 <i>Irlande</i> 55 687 206 2,00 710 296 KINGSPAN GROUP PLC EUR 55 687 206 2,00 <i>Luxembourg</i> 45 046 179 1,62 1 279 721 BEFESA SA EUR 45 046 179 1,62 <i>Brésil</i> 44 350 990 1,59 3 216 830 CIA SANEAMENTO BASICO DE - ADR USD 44 350 990 1,59 <i>Allemagne</i> 41 648 787 1,49 530 693 NEMETSCHKE AG EUR 41 648 787 1,49 <i>Chine</i> 30 527 285 1,09 57 554 934 XINYI SOLAR HOLDINGS LTD HKD 30 527 285 1,09 <i>Suède</i> 29 407 926 1,05 4 624 064 NIBE INDUSTRIER AB-B SEK 29 407 926 1,05 <i>Norvège</i> 18 938 111 0,68 1 720 998 TOMRA SYSTEMS ASA NOK 18 938 111 0,68 <i>Hong-Kong</i> 14 719 049 0,53 16 308 000 VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS HKD 14 719 049 0,53 | | | | |

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|-------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | | | 887 572 768 | 99,48 | | | | | |
| | Actions | | 887 572 768 | 99,48 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | 9 367 976 | 1,05 |
| 105 719 | ALPHABET INC - A | USD | 13 368 838 | 1,50 | 58 234 | FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | GBP | 9 367 976 | 1,05 |
| 642 632 | AMAZON.COM INC | USD | 88 391 352 | 9,92 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 51 693 | APPLE INC | USD | 9 009 599 | 1,01 | | | | 887 572 768 | 99,48 |
| 389 969 | AZEK CO INC/THE | USD | 13 503 204 | 1,51 | | | | | |
| 116 808 | BLOCK INC - A | USD | 8 179 151 | 0,92 | | | | | |
| 13 739 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 44 118 278 | 4,94 | | | | | |
| 92 269 | COLUMBIA SPORTSWEAR CO | USD | 6 643 802 | 0,74 | | | | | |
| 100 753 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 14 985 487 | 1,68 | | | | | |
| 103 370 | DICKS SPORTING GOODS INC | USD | 13 751 162 | 1,54 | | | | | |
| 64 272 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 7 960 035 | 0,89 | | | | | |
| 42 747 | ELF BEAUTY INC | USD | 5 585 572 | 0,63 | | | | | |
| 138 635 | FRONTDOOR INC | USD | 4 420 155 | 0,50 | | | | | |
| 38 512 | HERSHEY CO/THE | USD | 6 499 957 | 0,73 | | | | | |
| 141 813 | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | USD | 23 376 390 | 2,62 | | | | | |
| 214 509 | HOLOGIC INC | USD | 13 874 683 | 1,56 | | | | | |
| 234 941 | HOME DEPOT INC | USD | 73 705 521 | 8,26 | | | | | |
| 42 630 | MASIMO CORP | USD | 4 523 299 | 0,51 | | | | | |
| 24 287 | MERCADOLIBRE INC | USD | 34 552 113 | 3,87 | | | | | |
| 41 243 | MERITAGE HOMES CORP | USD | 6 503 898 | 0,73 | | | | | |
| 35 147 | MICROSOFT CORP | USD | 11 964 584 | 1,34 | | | | | |
| 360 884 | NIKE INC - B | USD | 35 469 312 | 3,98 | | | | | |
| 81 102 | PLANET FITNESS INC - A | USD | 5 359 567 | 0,60 | | | | | |
| 198 488 | SPROUTS FARMERS MARKET INC | USD | 8 644 600 | 0,97 | | | | | |
| 386 853 | STARBUCKS CORP | USD | 33 623 099 | 3,77 | | | | | |
| 352 400 | TESLA INC | USD | 79 268 865 | 8,88 | | | | | |
| 31 447 | ULTA BEAUTY INC | USD | 13 948 957 | 1,56 | | | | | |
| 61 223 | WALT DISNEY CO | USD | 5 004 141 | 0,56 | | | | | |
| 200 206 | WAYFAIR INC - A | USD | 11 182 465 | 1,25 | | | | | |
| 214 971 | YETI HOLDINGS INC | USD | 10 076 674 | 1,13 | | | | | |
| 142 132 | YUM CHINA HOLDINGS INC | USD | 5 459 341 | 0,61 | | | | | |
| | <i>Japon</i> | | | | | | | | |
| 102 400 | FAST RETAILING CO LTD | JPY | 23 055 054 | 2,58 | | | | | |
| 200 100 | NINTENDO CO LTD | JPY | 9 453 003 | 1,06 | | | | | |
| 481 300 | SONY CORP | JPY | 41 436 570 | 4,64 | | | | | |
| | <i>France</i> | | | | | | | | |
| 46 776 | LOREAL | EUR | 21 079 604 | 2,36 | | | | | |
| 70 764 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 51 912 470 | 5,82 | | | | | |
| | <i>Canada</i> | | | | | | | | |
| 69 214 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 32 035 872 | 3,59 | | | | | |
| 297 398 | MAGNA INTERNATIONAL INC | CAD | 15 984 683 | 1,79 | | | | | |
| 263 179 | SHOPIFY INC - A | USD | 18 559 403 | 2,08 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | |
| 213 817 | APTIV PLC | USD | 17 366 280 | 1,95 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | | | | | | | |
| 68 185 | ADIDAS AG | EUR | 12 556 950 | 1,41 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | | | | | | | |
| 36 976 | FERRARI NV | EUR | 11 285 075 | 1,26 | | | | | |
| | <i>Chine</i> | | | | | | | | |
| 235 500 | BYD CO LTD-H | HKD | 5 877 858 | 0,66 | | | | | |
| 136 000 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 4 647 869 | 0,52 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Disruptive Technology

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|-------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|----------------------------------|-------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 3 918 050 832 | 99,16 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | <i>3 146 119 643 79,63</i> | | | | |
| 1 323 854 | ADVANCED MICRO DEVICES | USD | 176 661 674 | 4,47 | 112 623 | Danemark GENMAB A/S | DKK | 32 557 641 | 0,82 |
| 1 360 393 | ALPHABET INC - A | USD | 172 030 325 | 4,35 | 871 181 | Suède HEMNET GROUP AB | SEK | 18 890 913 | 0,48 |
| 1 095 039 | AMAZON.COM INC | USD | 150 618 047 | 3,81 | 436 300 | Chine TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 14 910 773 | 0,38 |
| 344 247 | AMERICAN TOWER CORP - A | USD | 67 275 646 | 1,70 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 1 278 038 | APPLE INC | USD | 222 749 881 | 5,64 | | | | 3 918 050 832 | 99,16 |
| 308 008 | ARISTA NETWORKS INC | USD | 65 666 921 | 1,66 | | | | | |
| 158 434 | AXCELIS TECHNOLOGIES INC | USD | 18 600 738 | 0,47 | | | | | |
| 874 510 | BLOCK INC - A | USD | 61 235 096 | 1,55 | | | | | |
| 38 095 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 122 329 558 | 3,10 | | | | | |
| 2 489 921 | CIENA CORP | USD | 101 454 166 | 2,57 | | | | | |
| 2 315 956 | COPART INC | USD | 102 731 041 | 2,60 | | | | | |
| 1 329 103 | COSTAR GROUP INC | USD | 105 146 708 | 2,66 | | | | | |
| 1 102 856 | ENTEGRIS INC | USD | 119 625 407 | 3,03 | | | | | |
| 1 063 658 | FIRST SOLAR INC | USD | 165 886 933 | 4,20 | | | | | |
| 192 128 | GARTNER INC | USD | 78 460 021 | 1,99 | | | | | |
| 419 515 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 48 774 102 | 1,23 | | | | | |
| 183 782 | INTUIT INC | USD | 103 987 022 | 2,63 | | | | | |
| 114 873 | INTUITIVE SURGICAL INC | USD | 35 082 203 | 0,89 | | | | | |
| 223 775 | IRHYTHM TECHNOLOGIES INC | USD | 21 683 679 | 0,55 | | | | | |
| 647 830 | MICRON TECHNOLOGY INC | USD | 50 048 262 | 1,27 | | | | | |
| 852 092 | MICROSOFT CORP | USD | 290 065 337 | 7,34 | | | | | |
| 639 229 | NIKE INC - B | USD | 62 826 318 | 1,59 | | | | | |
| 176 182 | NVIDIA CORP | USD | 78 983 253 | 2,00 | | | | | |
| 447 236 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 119 387 092 | 3,02 | | | | | |
| 386 336 | PAYCOM SOFTWARE INC | USD | 72 297 450 | 1,83 | | | | | |
| 564 671 | PLEXUS CORP | USD | 55 273 503 | 1,40 | | | | | |
| 3 281 345 | PURE STORAGE INC - A | USD | 105 927 455 | 2,68 | | | | | |
| 353 682 | RAPID7 INC | USD | 18 282 028 | 0,46 | | | | | |
| 98 168 | REGENERON PHARMACEUTICALS | USD | 78 051 847 | 1,98 | | | | | |
| 337 979 | SNOWFLAKE INC-CLASS A | USD | 60 886 092 | 1,54 | | | | | |
| 293 063 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 64 706 528 | 1,64 | | | | | |
| 529 922 | VISA INC - A | USD | 124 894 937 | 3,16 | | | | | |
| 438 465 | WAYFAIR INC - A | USD | 24 490 373 | 0,62 | | | | | |
| <i>Israël</i> | | | | | <i>188 339 134 4,76</i> | | | | |
| 582 206 | CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | USD | 115 450 346 | 2,92 | | | | | |
| 2 326 397 | JFROG LTD | USD | 72 888 788 | 1,84 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | <i>120 183 028 3,04</i> | | | | |
| 176 299 | ASML HOLDING NV | EUR | 120 183 028 | 3,04 | | | | | |
| <i>Taiwan</i> | | | | | <i>118 970 295 3,01</i> | | | | |
| 1 263 659 | TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR | USD | 118 970 295 | 3,01 | | | | | |
| <i>Canada</i> | | | | | <i>72 584 408 1,84</i> | | | | |
| 1 029 273 | SHOPIFY INC - A | USD | 72 584 408 | 1,84 | | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | <i>68 538 931 1,73</i> | | | | |
| 403 360 | SIEMENS AG - REG | EUR | 68 538 931 | 1,73 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | <i>50 409 728 1,28</i> | | | | |
| 1 110 814 | STMICROELECTRONICS NV-NY | USD | 50 409 728 | 1,28 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | <i>43 435 315 1,10</i> | | | | |
| 534 784 | APTIV PLC | USD | 43 435 315 | 1,10 | | | | | |
| <i>Japon</i> | | | | | <i>43 111 023 1,09</i> | | | | |
| 108 000 | KEYENCE CORP | JPY | 43 111 023 | 1,09 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Ecosystem Restoration

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 82 196 297 | 98,23 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 1 975 | ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS INC | USD | 251 450 | 0,30 | | | | | |
| 15 965 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 1 907 591 | 2,28 | | | | | |
| 42 744 | BALL CORP | USD | 2 225 714 | 2,66 | | | | | |
| 25 092 | CASELLA WASTE SYSTEMS INC-A | USD | 1 941 214 | 2,32 | | | | | |
| 121 749 | DARLING INGREDIENTS INC | USD | 5 493 117 | 6,56 | | | | | |
| 5 795 | DEERE & CO | USD | 2 097 720 | 2,51 | | | | | |
| 72 202 | GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO | USD | 1 611 170 | 1,93 | | | | | |
| 5 420 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES | USD | 397 282 | 0,47 | | | | | |
| 11 970 | ITRON INC | USD | 818 227 | 0,98 | | | | | |
| 116 380 | MUELLER INDUSTRIES INC | USD | 4 967 471 | 5,94 | | | | | |
| 1 649 984 | ORIGIN MATERIALS INC | USD | 1 249 008 | 1,49 | | | | | |
| 92 477 | PURECYCLE TECHNOLOGIES INC | USD | 339 050 | 0,41 | | | | | |
| 1 606 | REPUBLIC SERVICES INC | USD | 239 755 | 0,29 | | | | | |
| 439 768 | SHIMMICK CORP | USD | 2 611 577 | 3,12 | | | | | |
| 415 316 | SUNNOVA ENERGY INTERNATIONAL | USD | 5 733 554 | 6,84 | | | | | |
| 153 330 | SUNRUN INC | USD | 2 724 725 | 3,26 | | | | | |
| 35 735 | TRIMBLE INC | USD | 1 720 999 | 2,06 | | | | | |
| 4 621 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 749 216 | 0,90 | | | | | |
| 15 535 | XYLEM INC | USD | 1 608 276 | 1,92 | | | | | |
| 3 589 | ZOETIS INC | USD | 641 254 | 0,77 | | | | | |
| <i>Canada</i> | | | | | | | | | |
| 36 202 | ANAERGIA INC | CAD | 6 213 | 0,01 | | | | | |
| 156 550 | GFL ENVIRONMENTAL INC-SUB VT | CAD | 4 912 742 | 5,87 | | | | | |
| 490 516 | LI-CYCLE HOLDINGS CORP | USD | 259 678 | 0,31 | | | | | |
| <i>Luxembourg</i> | | | | | | | | | |
| 137 612 | BEFESA SA | EUR | 4 843 942 | 5,79 | | | | | |
| <i>Suède</i> | | | | | | | | | |
| 4 218 266 | OATLY GROUP AB | USD | 4 506 001 | 5,38 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | | | | | |
| 41 246 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 3 794 632 | 4,53 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 24 135 | HALMA PLC | GBP | 636 136 | 0,76 | | | | | |
| 408 935 | TATE & LYLE PLC | GBP | 3 109 897 | 3,72 | | | | | |
| <i>Japon</i> | | | | | | | | | |
| 103 535 | KURITA WATER INDUSTRIES LTD | JPY | 3 675 914 | 4,39 | | | | | |
| <i>Irlande</i> | | | | | | | | | |
| 45 044 | KERRY GROUP PLC - A | EUR | 3 543 161 | 4,23 | | | | | |
| <i>Danemark</i> | | | | | | | | | |
| 64 699 | NOVOZYMES A/S - B | DKK | 3 220 825 | 3,85 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | | | | | |
| 53 989 | ARCADIS NV | EUR | 2 636 823 | 3,15 | | | | | |
| 3 610 | KONINKLIJKE DSM NV | EUR | 330 207 | 0,39 | | | | | |
| <i>Mexique</i> | | | | | | | | | |
| 842 925 | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | MXN | 1 695 159 | 2,03 | | | | | |
| <i>Inde</i> | | | | | | | | | |
| 234 319 | VA TECH WABAG LTD | INR | 1 600 444 | 1,91 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 52 441 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 1 497 715 | 1,79 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 82 196 297 98,23 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 295 600 | 0,07 | | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | | | | | |
| 1 231 330 | SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD | HKD | 295 600 | 0,07 | | | | | |
| Obligations | | | 350 761 286 | 83,21 | | | | | |
| <i>Brésil</i> | | | | | | | | | |
| 2 500 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 3,750% 21-12/09/2031 | USD | 2 225 325 | 0,53 | | | | | |
| 2 200 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 4,625% 17-13/01/2028 | USD | 2 174 414 | 0,52 | | | | | |
| 13 954 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 4,750% 19-14/01/2050 | USD | 10 709 694 | 2,53 | | | | | |
| 1 500 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 5,625% 09-07/01/2041 | USD | 1 381 500 | 0,33 | | | | | |
| 2 460 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 5,625% 16-21/02/2047 | USD | 2 154 960 | 0,51 | | | | | |
| 1 003 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 6,000% 23-20/10/2033 | USD | 1 001 345 | 0,24 | | | | | |
| 3 353 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 6,250% 23-18/03/2031 | USD | 3 476 993 | 0,82 | | | | | |
| <i>Indonésie</i> | | | | | | | | | |
| 800 000 | INDONESIA GOVERNMENT 2,150% 21-28/07/2031 | USD | 673 250 | 0,16 | | | | | |
| 1 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 4,450% 20-15/04/2070 | USD | 898 438 | 0,21 | | | | | |
| 2 400 000 | INDONESIA GOVERNMENT 4,650% 22-20/09/2032 | USD | 2 396 250 | 0,57 | | | | | |
| 4 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 7,750% 17/01/2038 | USD | 5 126 249 | 1,21 | | | | | |
| 2 650 000 | INDONESIA GOVERNMENT 8,500% 05-12/10/2035 | USD | 3 517 874 | 0,83 | | | | | |
| 1 650 000 | PERTAMINA 6,450% 14-30/05/2044 | USD | 1 798 500 | 0,43 | | | | | |
| 500 000 | PT PERTAMINA 2,300% 21-09/02/2031 | USD | 421 250 | 0,10 | | | | | |
| 1 000 000 | PT PERTAMINA 4,700% 19-30/07/2049 | USD | 886 563 | 0,21 | | | | | |
| 1 200 000 | SBSN INDO III 5,600% 23-15/11/2033 | USD | 1 276 632 | 0,30 | | | | | |
| <i>Qatar</i> | | | | | | | | | |
| 2 500 000 | QATAR PETROLEUM 1,375% 21-12/09/2026 | USD | 2 291 600 | 0,54 | | | | | |
| 2 600 000 | QATAR PETROLEUM 2,250% 21-12/07/2031 | USD | 2 209 870 | 0,52 | | | | | |
| 1 500 000 | QATAR PETROLEUM 3,300% 21-12/07/2051 | USD | 1 092 900 | 0,26 | | | | | |
| 2 000 000 | STATE OF QATAR 3,375% 19-14/03/2024 | USD | 1 986 560 | 0,47 | | | | | |
| 1 000 000 | STATE OF QATAR 4,400% 20-16/04/2050 | USD | 922 570 | 0,22 | | | | | |
| 2 000 000 | STATE OF QATAR 4,625% 16-02/06/2046 | USD | 1 907 660 | 0,45 | | | | | |
| 3 818 000 | STATE OF QATAR 5,103% 18-23/04/2048 | USD | 3 858 852 | 0,92 | | | | | |
| <i>Iles Caïmans</i> | | | | | | | | | |
| 3 338 000 | DP WORLD CRESCEN 5,500% 23-13/09/2033 | USD | 3 413 371 | 0,81 | | | | | |
| 500 000 | GACI FIRST INVST 4,875% 23-14/02/2035 | USD | 487 500 | 0,12 | | | | | |
| 4 135 000 | GACI FIRST INVST 5,125% 23-14/02/2053 | USD | 3 733 129 | 0,89 | | | | | |
| 2 429 000 | GACI FIRST INVST 5,375% 22-13/10/2122 | USD | 2 165 605 | 0,51 | | | | | |
| 1 400 000 | ICD FUNDING LTD 4,625% 14-21/05/2024 | USD | 1 385 944 | 0,33 | | | | | |
| 1 100 000 | ICD SUKUK CO LTD 5,000% 17-01/02/2027 | USD | 1 087 281 | 0,26 | | | | | |
| 1 200 000 | NOGAHOLDING 6,625% 23-25/05/2033 | USD | 1 254 000 | 0,30 | | | | | |
| <i>Chili</i> | | | | | | | | | |
| 700 000 | CHILE 2,550% 21-27/07/2033 | USD | 578 156 | 0,14 | | | | | |
| 1 500 000 | CHILE 2,750% 22-31/01/2027 | USD | 1 413 281 | 0,34 | | | | | |
| 1 000 000 | CHILE 3,100% 21-07/05/2041 | USD | 757 500 | 0,18 | | | | | |
| 1 600 000 | CHILE 3,250% 21-21/09/2071 | USD | 1 069 500 | 0,25 | | | | | |
| 400 000 | CHILE 3,500% 19-25/01/2050 | USD | 303 375 | 0,07 | | | | | |
| 200 000 | CHILE 3,625% 12-30/10/2042 | USD | 161 578 | 0,04 | | | | | |
| 1 500 000 | CHILE 4,950% 23-05/01/2036 | USD | 1 480 781 | 0,35 | | | | | |
| 700 000 | CODELCO INC 3,000% 19-30/09/2029 | USD | 622 563 | 0,15 | | | | | |
| 500 000 | CODELCO INC 3,750% 20-15/01/2031 | USD | 452 031 | 0,11 | | | | | |
| 350 000 | CODELCO INC 4,375% 19-05/02/2049 | USD | 282 297 | 0,07 | | | | | |
| 1 330 000 | CODELCO INC 4,500% 17-01/08/2047 | USD | 1 087 940 | 0,26 | | | | | |
| 208 000 | CODELCO INC 5,125% 23-02/02/2033 | USD | 200 782 | 0,05 | | | | | |
| 1 535 000 | CODELCO INC 5,950% 23-08/01/2034 | USD | 1 552 653 | 0,37 | | | | | |
| 758 000 | CODELCO INC 6,300% 23-08/09/2053 | USD | 765 679 | 0,18 | | | | | |
| 3 000 000 | EMPRESA NACIONAL 4,500% 17-14/09/2047 | USD | 2 247 210 | 0,53 | | | | | |
| 550 000 | EMPRESA NACIONAL 5,250% 18-06/11/2029 | USD | 531 223 | 0,13 | | | | | |
| <i>Turquie</i> | | | | | | | | | |
| 1 231 000 | HAZINE MUSTESARL 8,509% 23-14/01/2029 | USD | 1 305 476 | 0,31 | 11 885 245 | | | 2,82 | |
| 1 550 000 | REPUBLIC OF TURKEY 5,750% 17-11/05/2047 | USD | 1 209 000 | 0,29 | | | | | |
| 2 050 000 | REPUBLIC OF TURKEY 5,875% 21-26/06/2031 | USD | 1 911 625 | 0,45 | | | | | |
| 2 200 000 | REPUBLIC OF TURKEY 6,000% 11-14/01/2041 | USD | 1 862 410 | 0,44 | | | | | |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF TURKEY 6,500% 21-20/09/2033 | USD | 955 000 | 0,23 | | | | | |
| 1 333 000 | REPUBLIC OF TURKEY 9,125% 23-13/07/2030 | USD | 1 467 966 | 0,35 | | | | | |
| 2 000 000 | REPUBLIC OF TURKEY 9,375% 23-14/03/2029 | USD | 2 207 500 | 0,52 | | | | | |
| 857 000 | REPUBLIC OF TURKEY 9,375% 23-19/01/2033 | USD | 966 268 | 0,23 | | | | | |
| <i>Egypte</i> | | | | | | | | | |
| 1 650 000 | ARAB REP EGYPT 3,875% 21-16/02/2026 | USD | 1 345 266 | 0,32 | 11 844 896 | | | 2,80 | |
| 1 000 000 | ARAB REP EGYPT 5,750% 20-29/05/2024 | USD | 974 688 | 0,23 | | | | | |
| 850 000 | ARAB REP EGYPT 5,875% 21-16/02/2031 | USD | 554 625 | 0,13 | | | | | |
| 1 200 000 | ARAB REP EGYPT 7,053% 19-15/01/2032 | USD | 819 375 | 0,19 | | | | | |
| 1 800 000 | ARAB REP EGYPT 7,300% 21-30/09/2033 | USD | 1 185 188 | 0,28 | | | | | |
| 3 533 000 | ARAB REP EGYPT 7,500% 21-16/02/2061 | USD | 2 054 660 | 0,49 | | | | | |
| 500 000 | ARAB REP EGYPT 7,600% 19-01/03/2029 | USD | 380 313 | 0,09 | | | | | |
| 3 500 000 | ARAB REP EGYPT 7,625% 20-29/05/2032 | USD | 2 422 656 | 0,57 | | | | | |
| 500 000 | ARAB REP EGYPT 7,903% 18-21/02/2048 | USD | 300 156 | 0,07 | | | | | |
| 2 900 000 | ARAB REP EGYPT 8,700% 19-01/03/2049 | USD | 1 807 969 | 0,43 | | | | | |
| <i>Rép. dominicaine</i> | | | | | | | | | |
| 2 000 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 4,500% 20-30/01/2030 | USD | 1 837 500 | 0,44 | 11 518 521 | | | 2,74 | |
| 1 800 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 4,875% 20-23/09/2032 | USD | 1 636 452 | 0,39 | | | | | |
| 500 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 5,500% 22-22/02/2029 | USD | 488 700 | 0,12 | | | | | |
| 3 701 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 5,875% 20-30/01/2060 | USD | 3 197 664 | 0,76 | | | | | |
| 1 500 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 5,950% 17-25/01/2027 | USD | 1 503 120 | 0,36 | | | | | |
| 1 900 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 6,400% 19-05/06/2049 | USD | 1 786 000 | 0,42 | | | | | |
| 1 010 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 7,450% 14-30/04/2044 | USD | 1 069 085 | 0,25 | | | | | |
| <i>Colombie</i> | | | | | | | | | |
| 2 600 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 3,250% 21-22/04/2032 | USD | 2 066 188 | 0,49 | 11 021 795 | | | 2,60 | |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 3,875% 17-25/04/2027 | USD | 952 813 | 0,23 | | | | | |
| 1 200 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 4,125% 20-15/05/2051 | USD | 795 375 | 0,19 | | | | | |
| 400 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 4,500% 15-28/01/2026 | USD | 392 000 | 0,09 | | | | | |
| 1 500 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 5,000% 15-15/06/2045 | USD | 1 157 813 | 0,27 | | | | | |
| 500 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 5,200% 19-15/05/2049 | USD | 390 000 | 0,09 | | | | | |
| 1 916 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 6,125% 09-18/01/2041 | USD | 1 738 171 | 0,41 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 680 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 7,375% 06-18/09/2037 | USD | 704 438 | 0,17 | | | | | |
| 1 169 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 7,500% 23-02/02/2034 | USD | 1 231 468 | 0,29 | | | | | |
| 711 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 8,000% 23-14/11/2035 | USD | 776 990 | 0,18 | | | | | |
| 711 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 8,750% 23-14/11/2053 | USD | 816 539 | 0,19 | | | | | |
| | <i>Philippines</i> | | <i>10 987 970</i> | <i>2,59</i> | | | | | |
| 2 000 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 1,750% 21-28/04/2041 | EUR | 1 538 916 | 0,36 | | | | | |
| 800 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 4,200% 22-29/03/2047 | USD | 709 000 | 0,17 | | | | | |
| 992 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 5,000% 23-17/07/2033 | USD | 1 018 040 | 0,24 | | | | | |
| 2 000 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 6,375% 09-23/10/2034 | USD | 2 256 875 | 0,54 | | | | | |
| 133 333 | PHILIPPINES GOVERNMENT 7,500% 06-25/09/2024 | USD | 135 015 | 0,03 | | | | | |
| 3 775 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 9,500% 05-02/02/2030 | USD | 4 737 624 | 1,11 | | | | | |
| 500 000 | REPUBLIC OF PHILIPPINES 7,750% 06-14/01/2031 | USD | 592 500 | 0,14 | | | | | |
| | <i>Hongrie</i> | | <i>8 706 583</i> | <i>2,05</i> | | | | | |
| 750 000 | MVM ENERGETIKA 7,500% 23-09/06/2028 | USD | 781 641 | 0,19 | | | | | |
| 638 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 0,500% 20-18/11/2030 | EUR | 551 388 | 0,13 | | | | | |
| 600 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 2,125% 21-22/09/2031 | USD | 483 642 | 0,11 | | | | | |
| 1 900 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,125% 21-21/09/2051 | USD | 1 283 697 | 0,30 | | | | | |
| 1 643 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 5,500% 22-16/06/2034 | USD | 1 664 523 | 0,39 | | | | | |
| 750 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 6,125% 23-22/05/2028 | USD | 780 120 | 0,18 | | | | | |
| 1 100 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 6,250% 23-22/09/2032 | USD | 1 173 832 | 0,28 | | | | | |
| 900 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 6,750% 23-25/09/2052 | USD | 1 007 307 | 0,24 | | | | | |
| 820 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 7,625% 11-29/03/2041 | USD | 980 433 | 0,23 | | | | | |
| | <i>Bahreïn</i> | | <i>8 622 745</i> | <i>2,04</i> | | | | | |
| 1 000 000 | BAHRAIN 4,250% 21-25/01/2028 | USD | 941 250 | 0,22 | | | | | |
| 2 733 000 | BAHRAIN 5,250% 21-25/01/2033 | USD | 2 428 100 | 0,58 | | | | | |
| 1 500 000 | BAHRAIN 5,625% 21-18/05/2034 | USD | 1 355 625 | 0,32 | | | | | |
| 300 000 | BAHRAIN 6,000% 14-19/09/2044 | USD | 246 390 | 0,06 | | | | | |
| 750 000 | BAHRAIN 6,750% 17-20/09/2029 | USD | 760 781 | 0,18 | | | | | |
| 1 275 000 | BAHRAIN 7,500% 17-20/09/2047 | USD | 1 197 703 | 0,28 | | | | | |
| 412 000 | BAHRAIN 7,750% 23-18/04/2035 | USD | 429 896 | 0,10 | | | | | |
| 1 200 000 | OIL & GAS HLDING 7,500% 17-25/10/2027 | USD | 1 263 000 | 0,30 | | | | | |
| | <i>Pérou</i> | | <i>8 516 167</i> | <i>2,02</i> | | | | | |
| 1 683 000 | REPUBLIC OF PERU 2,780% 20-01/12/2060 | USD | 1 047 142 | 0,25 | | | | | |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF PERU 2,783% 20-23/01/2031 | USD | 869 063 | 0,21 | | | | | |
| 4 000 000 | REPUBLIC OF PERU 3,000% 21-15/01/2034 | USD | 3 367 499 | 0,80 | | | | | |
| 1 500 000 | REPUBLIC OF PERU 5,625% 10-18/11/2050 | USD | 1 562 813 | 0,37 | | | | | |
| 500 000 | REPUBLIC OF PERU 7,350% 05-21/07/2025 | USD | 515 625 | 0,12 | | | | | |
| 920 000 | REPUBLIC OF PERU 8,750% 03-21/11/2033 | USD | 1 154 025 | 0,27 | | | | | |
| | <i>Panama</i> | | <i>8 423 107</i> | <i>2,01</i> | | | | | |
| 500 000 | PANAMA 2,252% 20-29/09/2032 | USD | 364 844 | 0,09 | | | | | |
| 4 700 000 | PANAMA 3,870% 19-23/07/2060 | USD | 2 806 781 | 0,67 | | | | | |
| 500 000 | PANAMA 4,500% 18-16/04/2050 | USD | 346 250 | 0,08 | | | | | |
| 1 500 000 | PANAMA 4,500% 20-01/04/2056 | USD | 1 005 938 | 0,24 | | | | | |
| 971 000 | PANAMA 6,400% 22-14/02/2035 | USD | 946 725 | 0,22 | | | | | |
| 960 000 | PANAMA 6,700% 06-26/01/2036 | USD | 951 000 | 0,23 | | | | | |
| 360 000 | PANAMA 6,875% 23-31/01/2036 | USD | 358 875 | 0,09 | | | | | |
| 500 000 | PANAMA 7,125% 05-29/01/2026 | USD | 510 000 | 0,12 | | | | | |
| 1 001 000 | PANAMA 9,375% 99-01/04/2029 | USD | 1 132 694 | 0,27 | | | | | |
| | <i>Arabie saoudite</i> | | | | | | | <i>8 400 828</i> | <i>1,99</i> |
| 500 000 | SAUDI INT BOND 3,450% 21-02/02/2061 | USD | 350 781 | 0,08 | | | | | |
| 1 350 000 | SAUDI INT BOND 4,500% 20-22/04/2060 | USD | 1 165 641 | 0,28 | | | | | |
| 1 000 000 | SAUDI INT BOND 4,875% 23-18/07/2033 | USD | 1 020 000 | 0,24 | | | | | |
| 800 000 | SAUDI INT BOND 5,000% 18-17/04/2049 | USD | 754 250 | 0,18 | | | | | |
| 3 357 000 | SAUDI INT BOND 5,000% 23-18/01/2053 | USD | 3 154 531 | 0,75 | | | | | |
| 2 000 000 | SAUDI INT BOND 5,250% 19-16/01/2050 | USD | 1 955 625 | 0,46 | | | | | |
| | <i>Mexique</i> | | | | | | | <i>8 119 113</i> | <i>1,92</i> |
| 3 000 000 | MEXICAN UTD STS 7,500% 03-08/04/2033 | USD | 3 419 062 | 0,81 | | | | | |
| 800 000 | MEXICO CITY ARPT 5,500% 17-31/07/2047 | USD | 687 344 | 0,16 | | | | | |
| 500 000 | UNITED MEXICAN 3,750% 21-19/04/2071 | USD | 332 500 | 0,08 | | | | | |
| 500 000 | UNITED MEXICAN 3,771% 20-24/05/2061 | USD | 337 969 | 0,08 | | | | | |
| 2 000 000 | UNITED MEXICAN 4,400% 22-12/02/2052 | USD | 1 581 875 | 0,38 | | | | | |
| 1 152 280 | UNITED MEXICAN 4,875% 22-19/05/2033 | USD | 1 109 790 | 0,26 | | | | | |
| 622 000 | UNITED MEXICAN 6,350% 23-09/02/2035 | USD | 650 573 | 0,15 | | | | | |
| | <i>Afrique du Sud</i> | | | | | | | <i>7 703 109</i> | <i>1,82</i> |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4,300% 16-12/10/2028 | USD | 933 750 | 0,22 | | | | | |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4,850% 19-30/09/2029 | USD | 936 250 | 0,22 | | | | | |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5,650% 17-27/09/2047 | USD | 797 500 | 0,19 | | | | | |
| 2 500 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5,750% 19-30/09/2049 | USD | 1 993 700 | 0,47 | | | | | |
| 2 220 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5,875% 22-20/04/2032 | USD | 2 102 784 | 0,50 | | | | | |
| 1 100 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 6,300% 18-22/06/2048 | USD | 939 125 | 0,22 | | | | | |
| | <i>Ghana</i> | | | | | | | <i>7 400 391</i> | <i>1,75</i> |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF GHANA 7,750% 21-07/04/2029 | USD | 430 000 | 0,10 | | | | | |
| 2 300 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,125% 14-18/01/2026 | USD | 1 050 094 | 0,25 | | | | | |
| 1 979 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,125% 19-26/03/2032 | USD | 860 865 | 0,20 | | | | | |
| 2 250 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,625% 21-07/04/2034 | USD | 967 500 | 0,23 | | | | | |
| 7 797 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,750% 20-11/03/2061 | USD | 3 340 526 | 0,79 | | | | | |
| 1 750 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,950% 19-26/03/2051 | USD | 751 406 | 0,18 | | | | | |
| | <i>Sri Lanka</i> | | | | | | | <i>7 215 990</i> | <i>1,71</i> |
| 1 500 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 5,875% 12-25/07/2049 | USD | 774 600 | 0,18 | | | | | |
| 1 650 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,750% 18-18/04/2028 | USD | 827 578 | 0,20 | | | | | |
| 570 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,825% 16-18/07/2026 | USD | 290 700 | 0,07 | | | | | |
| 240 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,850% 19-14/03/2024 | USD | 120 675 | 0,03 | | | | | |
| 7 800 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 7,550% 19-28/03/2030 | USD | 3 902 437 | 0,92 | | | | | |
| 2 600 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 7,850% 19-14/03/2029 | USD | 1 300 000 | 0,31 | | | | | |
| | <i>Oman</i> | | | | | | | <i>7 008 020</i> | <i>1,65</i> |
| 1 000 000 | OMAN INTRNL BOND 4,750% 16-15/06/2026 | USD | 986 875 | 0,23 | | | | | |
| 1 500 000 | OMAN INTRNL BOND 6,250% 21-25/01/2031 | USD | 1 575 469 | 0,37 | | | | | |
| 500 000 | OMAN INTRNL BOND 6,500% 17-08/03/2047 | USD | 509 375 | 0,12 | | | | | |
| 2 760 000 | OMAN INTRNL BOND 6,750% 18-17/01/2048 | USD | 2 881 613 | 0,68 | | | | | |
| 1 000 000 | OMAN INTRNL BOND 6,750% 20-28/10/2027 | USD | 1 054 688 | 0,25 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Ukraine | | | | | Tunisie | | | | |
| 3 350 000 | UKRAINE GOVERNMENT 6,750% 19-20/06/2028 | EUR | 869 636 | 0,21 | 1 020 000 | BQ CENT TUNISIE 5,750% 15-30/01/2025 | USD | 830 981 | 0,20 |
| 1 610 000 | UKRAINE GOVERNMENT 6,876% 21-21/05/2031 | USD | 364 766 | 0,09 | 5 348 000 | TUNISIA INT BOND 6,375% 19-15/07/2026 | EUR | 4 091 059 | 0,96 |
| 9 507 000 | UKRAINE GOVERNMENT 7,253% 20-15/03/2035 | USD | 2 205 624 | 0,52 | Emirats Arabes Unis | | | | |
| 2 585 000 | UKRAINE GOVERNMENT 7,375% 17-25/09/2034 | USD | 601 013 | 0,14 | 400 000 | ABU DHABI GOVERNMENT 2,700% 20-02/09/2070 | USD | 252 692 | 0,06 |
| 4 500 000 | UKRAINE GOVERNMENT 7,750% 15-01/09/2026 | USD | 1 233 000 | 0,29 | 543 000 | ABU DHABI GOVERNMENT 3,125% 17-11/10/2027 | USD | 520 514 | 0,12 |
| 5 850 000 | UKRAINE GOVERNMENT 9,750% 18-01/11/2030 | USD | 1 659 938 | 0,39 | 1 350 000 | DP WORLD PLC 4,700% 19-30/09/2049 | USD | 1 140 170 | 0,27 |
| Pologne | | | | | Russie | | | | |
| 1 400 000 | BANK GOSPODARSTW 5,375% 23-22/05/2033 | USD | 1 417 710 | 0,34 | 5 200 000 | RUSSIA - EUROBOND 5,100% 19-28/03/2035 | USD | 2 132 000 | 0,51 |
| 1 200 000 | REPUBLIC OF POLAND 3,250% 16-06/04/2026 | USD | 1 161 420 | 0,28 | 3 600 000 | RUSSIA - EUROBOND 5,250% 17-23/06/2047 | USD | 1 260 000 | 0,30 |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF POLAND 4,000% 14-22/01/2024 | USD | 997 470 | 0,24 | 1 205 000 | RUSSIA 12,750% 98-24/06/2028 | USD | 1 205 000 | 0,29 |
| 2 000 000 | REPUBLIC OF POLAND 4,875% 23-04/10/2033 | USD | 2 021 500 | 0,48 | Malaisie | | | | |
| 1 200 000 | REPUBLIC OF POLAND 5,500% 23-04/04/2053 | USD | 1 248 492 | 0,30 | 1 313 000 | PETRONAS 7,625% 96 -15/10/2026 | USD | 1 407 851 | 0,33 |
| Nigeria | | | | | Uruguay | | | | |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 6,500% 17-28/11/2027 | USD | 911 875 | 0,22 | 384 816 | URUGUAY 5,750% 22-28/10/2034 | USD | 416 563 | 0,10 |
| 1 600 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 7,375% 21-28/09/2033 | USD | 1 361 500 | 0,32 | 2 500 000 | URUGUAY 7,625% 06-21/03/2036 | USD | 3 106 250 | 0,74 |
| 920 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 7,875% 17-16/02/2032 | USD | 824 838 | 0,20 | 650 000 | URUGUAY 7,875% 03-15/01/2033 | USD | 793 406 | 0,19 |
| 1 419 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 8,250% 21-28/09/2051 | USD | 1 162 693 | 0,28 | Costa Rica | | | | |
| 600 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 8,375% 22-24/03/2029 | USD | 574 688 | 0,14 | 800 000 | COSTA RICA 5,625% 13-30/04/2043 | USD | 729 200 | 0,17 |
| 1 500 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 8,747% 18-21/01/2031 | USD | 1 427 344 | 0,34 | 500 000 | COSTA RICA 6,125% 19-19/02/2031 | USD | 511 094 | 0,12 |
| 470 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 9,248% 18-21/01/2049 | USD | 422 559 | 0,10 | 667 000 | COSTA RICA 6,550% 23-03/04/2034 | USD | 690 679 | 0,16 |
| Sénégal | | | | | Angola | | | | |
| 3 500 000 | REPUBLIC OF SENEGAL 6,250% 17-23/05/2033 | USD | 3 117 188 | 0,74 | 500 000 | REPUBLIC OF ANGOLA 8,000% 19-26/11/2029 | USD | 443 750 | 0,11 |
| 4 000 000 | REPUBLIC OF SENEGAL 6,750% 18-13/03/2048 | USD | 3 138 750 | 0,74 | 420 000 | REPUBLIC OF ANGOLA 8,250% 18-09/05/2028 | USD | 386 400 | 0,09 |
| Hong-Kong | | | | | Guatemala | | | | |
| 2 500 000 | CNAC HK FINBRID 3,000% 20-22/09/2030 | USD | 2 183 400 | 0,52 | 1 000 000 | REPUBLIC OF GUATEMALA 3,700% 21-07/10/2033 | USD | 832 000 | 0,20 |
| 600 000 | HUARONG FINANCE 2019 3,875% 19-13/11/2029 | USD | 509 004 | 0,12 | 1 430 000 | REPUBLIC OF GUATEMALA 4,375% 17-05/06/2027 | USD | 1 368 510 | 0,32 |
| 4 300 000 | LI & FUNG LTD 5,250% 16-29/12/2049 | USD | 1 892 000 | 0,45 | 500 000 | REPUBLIC OF GUATEMALA 6,125% 19-01/06/2050 | USD | 473 000 | 0,11 |
| 1 900 000 | SHIMAO GROUP HOL 3,450% 21-11/01/2031 | USD | 66 500 | 0,02 | 1 000 000 | REPUBLIC OF GUATEMALA 6,600% 23-13/06/2036 | USD | 1 027 500 | 0,24 |
| 11 400 000 | SHIMAO GROUP HOL 5,600% 19-15/07/2026 | USD | 399 000 | 0,09 | Pays-Bas | | | | |
| 900 000 | SINOCHEM OVERSEA 6,300% 10-12/11/2040 | USD | 956 169 | 0,23 | 1 400 000 | MDC-GMTN B.V. 4,500% 18-07/11/2028 | USD | 1 389 514 | 0,33 |
| Roumanie | | | | | Maroc | | | | |
| 1 500 000 | ROMANIA 3,000% 20-14/02/2031 | USD | 1 275 255 | 0,30 | 4 549 000 | MOROCCO KINGDOM 4,000% 20-15/12/2050 | USD | 3 265 329 | 0,77 |
| 500 000 | ROMANIA 3,625% 22-27/03/2032 | USD | 431 640 | 0,10 | 900 000 | MOROCCO KINGDOM 5,500% 12-11/12/2042 | USD | 816 188 | 0,19 |
| 800 000 | ROMANIA 3,875% 15-29/10/2035 | EUR | 750 614 | 0,18 | 640 000 | MOROCCO KINGDOM 5,950% 23-08/03/2028 | USD | 655 600 | 0,16 |
| 1 500 000 | ROMANIA 4,000% 20-14/02/2051 | USD | 1 080 660 | 0,26 | 466 000 | MOROCCO KINGDOM 6,500% 23-08/09/2033 | USD | 491 193 | 0,12 |
| 750 000 | ROMANIA 6,000% 22-25/05/2034 | USD | 753 900 | 0,18 | | | | | |
| 1 000 000 | ROMANIA 7,125% 23-17/01/2033 | USD | 1 078 900 | 0,26 | | | | | |
| 372 000 | ROMANIA 7,625% 23-17/01/2053 | USD | 415 643 | 0,10 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Kenya | | 3 376 608 | 0,80 | | Luxembourg | | 2 171 274 | 0,52 |
| 1 172 000 | REPUBLIC OF KENYA 6,875% 14-24/06/2024 | USD | 1 136 108 | 0,27 | 1 020 000 | GAZPROM 5,150% 19-11/02/2026 | USD | 739 500 | 0,18 |
| 400 000 | REPUBLIC OF KENYA 7,000% 19-22/05/2027 | USD | 375 000 | 0,09 | 1 800 000 | GAZPROM 7,288% 07-16/08/2037 | USD | 1 431 774 | 0,34 |
| 600 000 | REPUBLIC OF KENYA 8,000% 19-22/05/2032 | USD | 541 500 | 0,13 | | Ouzbékistan | | 2 095 750 | 0,50 |
| 1 600 000 | REPUBLIC OF KENYA 8,250% 18-28/02/2048 | USD | 1 324 000 | 0,31 | 600 000 | REPUBLIC OF UZBEKISTAN 4,750% 19-20/02/2024 | USD | 597 000 | 0,14 |
| | Paraguay | | 3 184 685 | 0,76 | 700 000 | REPUBLIC OF UZBEKISTAN 5,375% 19-20/02/2029 | USD | 663 250 | 0,16 |
| 200 000 | PARAGUAY 2,739% 21-29/01/2033 | USD | 164 000 | 0,04 | 800 000 | UZBEK INTL BOND 7,850% 23-12/10/2028 | USD | 835 500 | 0,20 |
| 600 000 | PARAGUAY 4,950% 20-28/04/2031 | USD | 585 600 | 0,14 | | Azerbaïdjan | | 2 027 183 | 0,48 |
| 461 000 | PARAGUAY 5,000% 16-15/04/2026 | USD | 455 855 | 0,11 | 1 000 000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN 5,125% 17-01/09/2029 | USD | 976 870 | 0,23 |
| 500 000 | PARAGUAY 5,400% 19-30/03/2050 | USD | 445 750 | 0,11 | 1 000 000 | STATE OIL CO AZE 6,950% 15-18/03/2030 | USD | 1 050 313 | 0,25 |
| 1 560 000 | PARAGUAY 6,100% 14-11/08/2044 | USD | 1 533 480 | 0,36 | | Chine | | 1 718 981 | 0,41 |
| | Bolivie | | 3 184 402 | 0,76 | 12 190 000 | CHINA EVERGRANDE 7,500% 17-31/01/2024 | USD | 121 900 | 0,03 |
| 6 043 000 | BOLIVIA GOVERNMENT 4,500% 17-20/03/2028 | USD | 2 858 339 | 0,68 | 5 500 000 | CHINA EVERGRANDE 8,250% 17-30/09/2049 | USD | 55 000 | 0,01 |
| 600 000 | BOLIVIA GOVERNMENT 7,500% 22-02/03/2030 | USD | 326 063 | 0,08 | 5 000 000 | CHINA EVERGRANDE 9,500% 19-31/12/2049 | USD | 50 000 | 0,01 |
| | Serbie | | 3 060 201 | 0,72 | 3 100 000 | CIFI HOLDINGS 6,550% 19-28/03/2024 | USD | 186 000 | 0,04 |
| 900 000 | SERBIA REPUBLIC 2,125% 20-01/12/2030 | USD | 719 622 | 0,17 | 6 900 000 | COUNTRY GARDEN 3,125% 20-22/10/2025 | USD | 552 000 | 0,13 |
| 1 200 000 | SERBIA REPUBLIC 6,250% 23-26/05/2028 | USD | 1 226 652 | 0,29 | 1 700 000 | COUNTRY GARDEN 3,3,000% 21-12/01/2031 | USD | 127 500 | 0,03 |
| 1 089 000 | SERBIA REPUBLIC 6,500% 23-26/09/2033 | USD | 1 113 927 | 0,26 | 600 000 | COUNTRY GARDEN 8,000% 18-27/01/2024 | USD | 45 000 | 0,01 |
| | Zambie | | 2 820 028 | 0,67 | 2 900 000 | KWG GROUP 6,300% 20-13/02/2026 | USD | 152 250 | 0,04 |
| 4 400 000 | REPUBLIC OF ZAMBIA 5,375% 12-31/12/2099 | USD | 2 448 028 | 0,58 | 3 600 000 | LOGAN PROPERTY H 6,900% 19-09/06/2024 | USD | 234 000 | 0,06 |
| 600 000 | REPUBLIC OF ZAMBIA 8,500% 14-14/04/2024 | USD | 372 000 | 0,09 | 135 611 | SUNAC CHINA HLDG 6,000% 23-30/09/2025 | USD | 16 273 | 0,00 |
| | Inde | | 2 648 858 | 0,62 | 135 611 | SUNAC CHINA HLDG 6,250% 23-30/09/2026 | USD | 13 900 | 0,00 |
| 2 392 000 | EX - IM BANK OF INDIA 3,250% 20-15/01/2030 | USD | 2 169 353 | 0,51 | 271 223 | SUNAC CHINA HLDG 6,500% 23-30/09/2027 | USD | 23 732 | 0,01 |
| 500 000 | EX - IM BANK OF INDIA 3,875% 18-01/02/2028 | USD | 479 505 | 0,11 | 406 835 | SUNAC CHINA HLDG 6,750% 23-30/09/2028 | USD | 31 530 | 0,01 |
| | Kazakhstan | | 2 581 102 | 0,61 | 406 835 | SUNAC CHINA HLDG 7,000% 23-30/09/2029 | USD | 29 496 | 0,01 |
| 500 000 | KAZAKHSTAN 4,875% 14-14/10/2044 | USD | 481 406 | 0,11 | 191 111 | SUNAC CHINA HLDG 7,250% 23-30/09/2030 | USD | 12 900 | 0,00 |
| 800 000 | KAZAKHSTAN 6,500% 15-21/07/2045 | USD | 911 640 | 0,22 | 5 400 000 | TIMES CN HLDG 6,750% 20-08/07/2025 | USD | 67 500 | 0,02 |
| 256 000 | KAZMUNAYGAS NAT 4,750% 17-19/04/2027 | USD | 249 306 | 0,06 | | Mongolie | | 1 452 782 | 0,35 |
| 1 000 000 | KAZMUNAYGAS NAT 6,375% 18-24/10/2048 | USD | 938 750 | 0,22 | 1 500 000 | MONGOLIA 4,450% 21-07/07/2031 | USD | 1 258 594 | 0,30 |
| | Pakistan | | 2 514 519 | 0,60 | 200 000 | MONGOLIA 5,125% 20-07/04/2026 | USD | 194 188 | 0,05 |
| 2 058 000 | REPUBLIC OF PAKISTAN 7,375% 21-08/04/2031 | USD | 1 247 019 | 0,30 | | Gabon | | 1 360 464 | 0,32 |
| 1 500 000 | REPUBLIC OF PAKISTAN 8,250% 15-30/09/2025 | USD | 1 267 500 | 0,30 | 800 000 | REPUBLIC OF GABON 6,625% 20-06/02/2031 | USD | 665 750 | 0,16 |
| | Jamaïque | | 2 376 295 | 0,57 | 732 000 | REPUBLIC OF GABON 6,950% 15-16/06/2025 | USD | 694 714 | 0,16 |
| 1 130 000 | JAMAICA GOVERNMENT 7,875% 15-28/07/2045 | USD | 1 380 295 | 0,33 | | Trinidad-et-Tobago | | 1 112 020 | 0,27 |
| 800 000 | JAMAICA GOVERNMENT 8,000% 07-15/03/2039 | USD | 996 000 | 0,24 | 600 000 | TRINIDAD & TOBAGO 5,950% 23-14/01/2031 | USD | 619 500 | 0,15 |
| | Salvador | | 2 376 040 | 0,57 | 500 000 | TRINIDAD GEN UNL 5,250% 16-04/11/2027 | USD | 492 520 | 0,12 |
| 560 000 | EL SALVADOR REP 6,375% 14-18/01/2027 | USD | 491 750 | 0,12 | | Côte d'Ivoire | | 1 106 538 | 0,27 |
| 508 000 | EL SALVADOR REP 7,125% 19-20/01/2050 | USD | 358 616 | 0,09 | 200 000 | IVORY COAST-PDI 5,875% 19-17/10/2031 | EUR | 197 594 | 0,05 |
| 500 000 | EL SALVADOR REP 7,625% 11-01/02/2041 | USD | 373 125 | 0,09 | 990 000 | IVORY COAST-PDI 6,125% 17-15/06/2033 | USD | 908 944 | 0,22 |
| 370 000 | EL SALVADOR REP 8,250% 02-10/04/2032 | USD | 311 725 | 0,07 | | Namibie | | 1 054 619 | 0,25 |
| 385 000 | EL SALVADOR REP 8,625% 17-28/02/2029 | USD | 343 011 | 0,08 | 1 070 000 | REPUBLIC OF NAMIBIA 5,250% 15-29/10/2025 | USD | 1 054 619 | 0,25 |
| 600 000 | EL SALVADOR REP 9,500% 20-15/07/2052 | USD | 497 813 | 0,12 | | Croatie | | 1 000 070 | 0,24 |
| | Cameroun | | 2 272 403 | 0,54 | 1 000 000 | CROATIA 6,000% 13-26/01/2024 | USD | 1 000 070 | 0,24 |
| 2 800 000 | REPUBLIC OF CAMEROON 5,950% 21-07/07/2032 | EUR | 2 272 403 | 0,54 | | Argentine | | 797 008 | 0,19 |
| | | | | | 2 012 239 | ARGENTINA 1,000% 20-09/07/2029 | USD | 797 008 | 0,19 |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Vietnam</i> | | 789 000 | 0,19 | | <i>Chine</i> | | 115 000 | 0,03 |
| 800 000 | REPUBLIC OF VIETNAM 4,800% 14-19/11/2024 | USD | 789 000 | 0,19 | 2 000 000 | CHINA SCE GRP 7,000% 20-02/05/2025 DFLT | USD | 115 000 | 0,03 |
| | <i>Honduras</i> | | 670 250 | 0,16 | | <i>Iles Vierges britanniques</i> | | 42 500 | 0,01 |
| 700 000 | HONDURAS GOVERNMENT 6,250% 17-19/01/2027 | USD | 670 250 | 0,16 | 4 250 000 | SCENERY JOURNEY 13,750% 18-06/11/2099 DFLT | USD | 42 500 | 0,01 |
| | <i>Ethiopie</i> | | 665 000 | 0,16 | | Instruments du marché monétaire | | 6 849 063 | 1,61 |
| 1 000 000 | ETHIOPIA 6,625% 14-11/12/2024 | USD | 665 000 | 0,16 | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 6 849 063 | 1,61 |
| | <i>Suriname</i> | | 581 485 | 0,14 | | US TREASURY BILL 0,000% 23-13/06/2024 | USD | 1 954 088 | 0,46 |
| 259 000 | SURINAME INTL 0,000% 23-31/12/2050 | USD | 117 845 | 0,03 | 5 000 000 | US TREASURY BILL 0,000% 23-30/05/2024 | USD | 4 894 975 | 1,15 |
| 536 000 | SURINAME INTL 7,950% 23-15/07/2033 | USD | 463 640 | 0,11 | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 36 379 563 | 8,60 |
| | <i>Tadjikistan</i> | | 502 170 | 0,12 | | <i>Luxembourg</i> | | 36 379 563 | 8,60 |
| 570 000 | TAJKISTAN INT BOND 7,125% 17-14/09/2027 | USD | 502 170 | 0,12 | 41,00 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ASIAN CITIES BOND - X CAP | USD | 4 271 963 | 1,00 |
| | <i>Papouasie-Nouvelle-Guinée</i> | | 431 723 | 0,10 | 228 254,49 | BNP PARIBAS INSTCASH USD 1D I VNAV - X CAP | USD | 32 107 600 | 7,60 |
| 465 000 | PNG GOVERNMENT INTERNATIONAL BO 8,375% 18-04/10/2028 | USD | 431 723 | 0,10 | | Total portefeuille-titres | | 411 054 685 | 97,47 |
| | <i>Arménie</i> | | 392 625 | 0,09 | | | | | |
| 450 000 | ARMENIA 3,950% 19-26/09/2029 | USD | 392 625 | 0,09 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | 0 | 0,00 | | | | | |
| 2 344 000 | GTLK EU CAPITAL 4,800% 20-26/02/2028 | USD | 0 | 0,00 | | | | | |
| 2 000 000 | GTLK EU CAPITAL 4,949% 19-18/02/2026 | USD | 0 | 0,00 | | | | | |
| 1 222 000 | GTLK EUROPE DAC 5,125% 17-31/05/2024 | USD | 0 | 0,00 | | | | | |
| | Obligations convertibles | | 30 554 | 0,01 | | | | | |
| | <i>Chine</i> | | 30 554 | 0,01 | | | | | |
| 397 768 | SUNAC CHINA HLDG 1,000% 23-30/09/2032 CV | USD | 30 554 | 0,01 | | | | | |
| | Obligations à taux flottant | | 14 591 134 | 3,45 | | | | | |
| | <i>Mexique</i> | | 5 610 567 | 1,32 | | | | | |
| 5 288 000 | CEMEX SAB 23-14/06/2171 FRN | USD | 5 610 567 | 1,32 | | | | | |
| | <i>Argentine</i> | | 4 866 883 | 1,15 | | | | | |
| 1 822 649 | ARGENTINA 20-09/01/2038 SR FRN | USD | 719 254 | 0,17 | | | | | |
| 5 890 363 | ARGENTINA 20-09/07/2030 SR FRN | USD | 2 352 022 | 0,56 | | | | | |
| 1 802 121 | ARGENTINA 20-09/07/2035 SR FRN | USD | 609 982 | 0,14 | | | | | |
| 3 500 000 | ARGENTINA 20-09/07/2041 SR FRN | USD | 1 185 625 | 0,28 | | | | | |
| | <i>Equateur</i> | | 3 062 806 | 0,73 | | | | | |
| 373 440 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2030 SR FRN | USD | 172 903 | 0,04 | | | | | |
| 1 455 451 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2030 SR FRN | USD | 412 620 | 0,10 | | | | | |
| 3 404 373 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2035 SR FRN | USD | 1 206 850 | 0,29 | | | | | |
| 4 033 120 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2040 SR FRN | USD | 1 270 433 | 0,30 | | | | | |
| | <i>Mozambique</i> | | 715 026 | 0,17 | | | | | |
| 844 000 | MOZAMBIQUE REP O 19-15/09/2031 SR | USD | 715 026 | 0,17 | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | 335 852 | 0,08 | | | | | |
| 448 910 | ECUADOR SOC BON 20-30/01/2035 SR | USD | 335 852 | 0,08 | | | | | |
| | Autres valeurs mobilières | | 2 147 485 | 0,52 | | | | | |
| | Obligations | | 2 147 485 | 0,52 | | | | | |
| | <i>Venezuela</i> | | 1 712 391 | 0,41 | | | | | |
| 12 150 000 | VENEZUELA 0,000% 07-31/03/2038 DFLT | USD | 1 712 391 | 0,41 | | | | | |
| | <i>Liban</i> | | 277 594 | 0,07 | | | | | |
| 4 700 000 | REPUBLIC OF LEBANON 6,600% 11-27/11/2026 DFLT | USD | 277 594 | 0,07 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 203 624 | 0,07 | | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | | | | | |
| 844 340 | SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD | HKD | 202 697 | 0,07 | | | | | |
| <i>Kazakhstan</i> | | | | | | | | | |
| 308 936 | FORTEBANK JSC -SPON GDR REGS | USD | 927 | 0,00 | | | | | |
| | Obligations | | 202 123 692 | 70,16 | | | | | |
| <i>Brésil</i> | | | | | | | | | |
| 17 000 000 | BRAZIL NTN-F 10,000% 14-01/01/2025 FLAT | BRL | 3 501 651 | 1,22 | | | | | |
| 30 500 000 | BRAZIL NTN-F 10,000% 16-01/01/2027 FLAT | BRL | 6 305 606 | 2,19 | | | | | |
| 4 510 000 | BRAZIL NTN-F 10,000% 18-01/01/2029 FLAT | BRL | 925 155 | 0,32 | | | | | |
| 4 800 000 | BRAZIL NTN-F 10,000% 20-01/01/2031 FLAT | BRL | 975 869 | 0,34 | | | | | |
| 1 600 000 | BRAZIL NTN-F 10,000% 22-01/01/2033 FLAT | BRL | 323 000 | 0,11 | | | | | |
| 500 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 3,875% 20-12/06/2030 | USD | 456 875 | 0,16 | | | | | |
| 5 559 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 4,750% 19-14/01/2050 | USD | 4 266 532 | 1,48 | | | | | |
| 990 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 5,625% 16-21/02/2047 | USD | 867 240 | 0,30 | | | | | |
| 328 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 6,000% 23-20/10/2033 | USD | 327 459 | 0,11 | | | | | |
| 1 447 000 | REPUBLIC OF BRAZIL 6,250% 23-18/03/2031 | USD | 1 500 510 | 0,52 | | | | | |
| <i>Afrique du Sud</i> | | | | | | | | | |
| 300 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 4,850% 19-30/09/2029 | USD | 280 875 | 0,10 | | | | | |
| 1 800 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5,750% 19-30/09/2049 | USD | 1 435 464 | 0,50 | | | | | |
| 500 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 5,875% 22-20/04/2032 | USD | 473 600 | 0,16 | | | | | |
| 122 000 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8,250% 13-31/03/2032 | ZAR | 5 825 300 | 2,02 | | | | | |
| 53 974 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8,500% 13-31/01/2037 | ZAR | 2 301 095 | 0,80 | | | | | |
| 38 350 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8,750% 14-31/01/2044 | ZAR | 1 553 945 | 0,54 | | | | | |
| 33 500 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8,875% 15-28/02/2035 | ZAR | 1 545 547 | 0,54 | | | | | |
| 41 730 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 9,000% 15-31/01/2040 | ZAR | 1 778 164 | 0,62 | | | | | |
| <i>Malaisie</i> | | | | | | | | | |
| 8 600 000 | MALAYSIA INVEST 3,422% 20-30/09/2027 | MYR | 1 864 101 | 0,65 | | | | | |
| 2 600 000 | MALAYSIA INVEST 3,465% 20-15/10/2030 | MYR | 555 644 | 0,19 | | | | | |
| 3 900 000 | MALAYSIA INVEST 3,655% 19-15/10/2024 | MYR | 851 281 | 0,30 | | | | | |
| 14 400 000 | MALAYSIA INVEST 3,726% 19-31/03/2026 | MYR | 3 151 964 | 1,09 | | | | | |
| 2 655 000 | MALAYSIA INVEST 4,119% 19-30/11/2034 | MYR | 590 510 | 0,21 | | | | | |
| 2 000 000 | MALAYSIA INVEST 4,638% 19-15/11/2049 | MYR | 458 112 | 0,16 | | | | | |
| 1 400 000 | MALAYSIAN GOVERNMENT 3,733% 13-15/06/2028 | MYR | 305 877 | 0,11 | | | | | |
| 560 000 | MALAYSIAN GOVERNMENT 3,757% 19-22/05/2040 | MYR | 117 170 | 0,04 | | | | | |
| 4 840 000 | MALAYSIAN GOVERNMENT 3,828% 19-05/07/2034 | MYR | 1 049 109 | 0,36 | | | | | |
| 6 300 000 | MALAYSIAN GOVERNMENT 3,885% 19-15/08/2029 | MYR | 1 385 168 | 0,48 | | | | | |
| 3 780 000 | MALAYSIAN GOVERNMENT 4,065% 20-15/06/2050 | MYR | 809 523 | 0,28 | | | | | |
| 3 770 000 | MALAYSIAN GOVERNMENT 4,736% 16-15/03/2046 | MYR | 882 347 | 0,31 | | | | | |
| 7 555 000 | MALAYSIAN GOVERNMENT 4,762% 17-07/04/2037 | MYR | 1 779 532 | 0,62 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 40 000 000 | INT BK RECON&DEV 0,000% 17-13/03/2027 | MXN | 1 746 210 | 0,61 | | | | | |
| 7 000 000 | INT BK RECON&DEV 0,000% 23-08/02/2038 | BRL | 447 614 | 0,16 | | | | | |
| 25 500 000 000 | INT BK RECON&DEV 5,350% 22-09/02/2029 | IDR | 1 589 920 | 0,55 | | | | | |
| 810 000 000 | INT BK RECON&DEV 6,250% 22-27/04/2026 | CLP | 950 881 | 0,33 | | | | | |
| 23 000 000 000 | INT BK RECON&DEV 6,250% 23-12/01/2028 | IDR | 1 494 246 | 0,52 | | | | | |
| 27 600 000 | INTL FIN CORP 0,000% 17-21/11/2047 | MXN | 187 118 | 0,06 | | | | | |
| 44 000 000 | INTL FIN CORP 0,000% 18-22/02/2038 | MXN | 750 633 | 0,26 | | | | | |
| 77 000 000 | INTL FIN CORP 0,000% 22-07/11/2047 | MXN | 530 897 | 0,18 | | | | | |
| 5 500 000 000 | INTL FIN CORP 12,000% 22-03/11/2027 | COP | 1 506 035 | 0,52 | | | | | |
| 31 000 000 | INTL FIN CORP 7,000% 17-20/07/2027 | MXN | 1 699 329 | 0,59 | | | | | |
| <i>Thaïlande</i> | | | | | | | | | |
| 22 300 000 | THAILAND GOVERNMENT 1,000% 21-17/06/2027 | THB | 621 505 | 0,22 | | | | | |
| 77 330 000 | THAILAND GOVERNMENT 2,650% 22-17/06/2028 | THB | 2 282 572 | 0,79 | | | | | |
| 7 300 000 | THAILAND GOVERNMENT 2,875% 16-17/06/2046 | THB | 195 103 | 0,07 | | | | | |
| 26 000 000 | THAILAND GOVERNMENT 2,875% 18-17/12/2028 | THB | 776 141 | 0,27 | | | | | |
| 25 730 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,300% 18-17/06/2038 | THB | 777 165 | 0,27 | | | | | |
| 24 700 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,350% 22-17/06/2033 | THB | 761 902 | 0,26 | | | | | |
| 49 130 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,400% 15-17/06/2036 | THB | 1 513 302 | 0,53 | | | | | |
| 9 475 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,600% 17-17/06/2067 | THB | 267 379 | 0,09 | | | | | |
| 28 245 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,650% 10-20/06/2031 | THB | 883 880 | 0,31 | | | | | |
| 39 000 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,775% 12-25/06/2032 | THB | 1 239 692 | 0,43 | | | | | |
| 12 400 000 | THAILAND GOVERNMENT 4,000% 15-17/06/2066 | THB | 376 430 | 0,13 | | | | | |
| 17 500 000 | THAILAND GOVERNMENT 4,875% 09-22/06/2029 | THB | 574 191 | 0,20 | | | | | |
| <i>Indonésie</i> | | | | | | | | | |
| 500 000 | INDONESIA GOVERNMENT 3,700% 19-30/10/2049 | USD | 417 031 | 0,14 | | | | | |
| 1 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 4,450% 20-15/04/2070 | USD | 898 438 | 0,31 | | | | | |
| 13 400 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 7,125% 21-15/06/2042 | IDR | 901 648 | 0,31 | | | | | |
| 1 580 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 7,125% 22-15/06/2043 | IDR | 106 382 | 0,04 | | | | | |
| 2 125 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 7,375% 17-15/05/2048 | IDR | 145 106 | 0,05 | | | | | |
| 7 885 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 7,500% 16-15/08/2032 | IDR | 542 046 | 0,19 | | | | | |
| 8 200 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 7,500% 17-15/05/2038 | IDR | 569 633 | 0,20 | | | | | |
| 11 695 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 8,250% 11-15/06/2032 | IDR | 835 019 | 0,29 | | | | | |
| 4 822 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 8,250% 15-15/05/2036 | IDR | 353 024 | 0,12 | | | | | |
| 27 400 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 8,375% 13-15/03/2034 | IDR | 2 014 421 | 0,70 | | | | | |
| 15 300 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 8,375% 19-15/04/2039 | IDR | 1 141 950 | 0,40 | | | | | |
| 6 700 000 000 | INDONESIA GOVERNMENT 9,500% 10-15/07/2031 | IDR | 508 472 | 0,18 | | | | | |
| 500 000 | PT PERTAMINA 2,300% 21-09/02/2031 | USD | 421 250 | 0,15 | | | | | |
| 900 000 | SBSN INDO III 5,600% 23-15/11/2033 | USD | 957 474 | 0,33 | | | | | |
| <i>Colombie</i> | | | | | | | | | |
| 840 000 000 | COLOMBIA TES 6,250% 21-09/07/2036 | COP | 158 129 | 0,05 | | | | | |
| 5 538 900 000 | COLOMBIA TES 7,000% 17-30/06/2032 | COP | 1 195 925 | 0,42 | | | | | |
| 4 700 000 000 | COLOMBIA TES 7,250% 19-18/10/2034 | COP | 996 754 | 0,35 | | | | | |
| 1 340 000 000 | COLOMBIA TES 7,250% 20-26/10/2050 | COP | 251 086 | 0,09 | | | | | |
| 4 050 000 000 | COLOMBIA TES 9,250% 22-28/05/2042 | COP | 952 325 | 0,33 | | | | | |
| 500 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 3,875% 21-15/02/2061 | USD | 310 469 | 0,11 | | | | | |
| 1 600 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 4,125% 20-15/05/2051 | USD | 1 060 500 | 0,37 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 400 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 4,500% 15-28/01/2026 | USD | 392 000 | 0,14 | 500 000 | REPUBLIC OF TURKEY 9,125% 23-13/07/2030 | USD | 550 625 | 0,19 |
| 414 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 6,125% 09-18/01/2041 | USD | 375 576 | 0,13 | 800 000 | REPUBLIC OF TURKEY 9,375% 23-14/03/2029 | USD | 883 000 | 0,31 |
| 876 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 7,375% 06-18/09/2037 | USD | 907 481 | 0,32 | 700 000 | REPUBLIC OF TURKEY 9,375% 23-19/01/2033 | USD | 789 250 | 0,27 |
| 200 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 7,500% 23-02/02/2034 | USD | 210 688 | 0,07 | 12 500 000 | TURKEY GOVERNMENT BOND 17,300% 23-19/07/2028 | TRY | 340 920 | 0,12 |
| 400 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 8,000% 23-14/11/2035 | USD | 437 125 | 0,15 | 2 550 000 | TURKEY GOVERNMENT BOND 17,800% 23-13/07/2033 | TRY | 67 346 | 0,02 |
| 400 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 8,750% 23-14/11/2053 | USD | 459 375 | 0,16 | | <i>Chili</i> | | <i>4 899 567</i> | <i>1,70</i> |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>7 521 465</i> | <i>2,61</i> | 400 000 | CHILE 3,250% 21-21/09/2071 | USD | 267 375 | 0,09 |
| 23 900 000 | EIB 1,000% 21-25/02/2028 | PLN | 5 192 473 | 1,80 | 1 000 000 | CHILE 4,950% 23-05/01/2036 | USD | 987 188 | 0,34 |
| 7 800 000 | EIB 3,000% 19-25/11/2029 | PLN | 1 785 242 | 0,62 | 850 000 | CODELCO INC 4,375% 19-05/02/2049 | USD | 685 578 | 0,24 |
| 750 000 | GAZPROM 5,150% 19-11/02/2026 | USD | 543 750 | 0,19 | 353 000 | CODELCO INC 5,125% 23-02/02/2033 | USD | 340 751 | 0,12 |
| | <i>République tchèque</i> | | <i>7 068 308</i> | <i>2,45</i> | 440 000 | CODELCO INC 5,950% 23-08/01/2034 | USD | 445 060 | 0,15 |
| 37 810 000 | CZECH REPUBLIC 0,250% 17-10/02/2027 | CZK | 1 508 197 | 0,52 | 431 000 | CODELCO INC 6,300% 23-08/09/2053 | USD | 435 366 | 0,15 |
| 36 140 000 | CZECH REPUBLIC 0,950% 15-15/05/2030 | CZK | 1 364 256 | 0,47 | 300 000 | EMPRESA NACIONAL 4,500% 17-14/09/2047 | USD | 224 721 | 0,08 |
| 31 070 000 | CZECH REPUBLIC 1,200% 20-13/03/2031 | CZK | 1 168 252 | 0,41 | 460 000 000 | TESORERIA PESOS 4,700% 18-01/09/2030 FLAT | CLP | 514 884 | 0,18 |
| 21 850 000 | CZECH REPUBLIC 2,000% 17-13/10/2033 | CZK | 836 503 | 0,29 | 260 000 000 | TESORERIA PESOS 5,100% 19-15/07/2050 FLAT | CLP | 296 219 | 0,10 |
| 16 200 000 | CZECH REPUBLIC 2,500% 13-25/08/2028 | CZK | 686 138 | 0,24 | 300 000 000 | TESORERIA PESOS 5,300% 23-01/11/2037 FLAT | CLP | 341 640 | 0,12 |
| 13 900 000 | CZECH REPUBLIC 2,750% 18-23/07/2029 | CZK | 589 868 | 0,20 | 160 000 000 | TESORERIA PESOS 5,800% 23-01/10/2034 FLAT | CLP | 190 774 | 0,07 |
| 16 250 000 | CZECH REPUBLIC 4,200% 06-04/12/2036 | CZK | 753 686 | 0,26 | 140 000 000 | TESORERIA PESOS 6,000% 23-01/04/2033 FLAT | CLP | 170 011 | 0,06 |
| 3 220 000 | CZECH REPUBLIC 4,850% 07-26/11/2057 | CZK | 161 408 | 0,06 | | <i>Iles Caïmans</i> | | <i>4 284 463</i> | <i>1,49</i> |
| | <i>Roumanie</i> | | <i>6 484 250</i> | <i>2,24</i> | 1 100 000 | DP WORLD CRESCEN 5,500% 23-13/09/2033 | USD | 1 124 838 | 0,39 |
| 5 560 000 | ROMANIA 3,250% 20-24/06/2026 | RON | 1 155 667 | 0,40 | 500 000 | GACI FIRST INVST 4,875% 23-14/02/2035 | USD | 487 500 | 0,17 |
| 700 000 | ROMANIA 3,375% 20-28/01/2050 | EUR | 525 071 | 0,18 | 1 591 000 | GACI FIRST INVST 5,125% 23-14/02/2053 | USD | 1 436 375 | 0,50 |
| 2 850 000 | ROMANIA 3,650% 16-24/09/2031 | RON | 532 271 | 0,18 | 800 000 | GACI FIRST INVST 5,375% 22-13/10/2122 | USD | 713 250 | 0,25 |
| 2 400 000 | ROMANIA 4,750% 19-11/10/2034 | RON | 469 944 | 0,16 | 500 000 | NOGAHOLDING 6,625% 23-25/05/2033 | USD | 522 500 | 0,18 |
| 5 340 000 | ROMANIA 5,000% 18-12/02/2029 | RON | 1 123 136 | 0,39 | | <i>Pérou</i> | | <i>4 011 950</i> | <i>1,40</i> |
| 5 800 000 | ROMANIA 5,800% 12-26/07/2027 | RON | 1 272 688 | 0,44 | 550 000 | REPUBLIC OF PERU 2,780% 20-01/12/2060 | USD | 342 203 | 0,12 |
| 550 000 | ROMANIA 6,000% 22-25/05/2034 | USD | 552 860 | 0,19 | 1 075 000 | REPUBLIC OF PERU 5,350% 19-12/08/2040 | PEN | 248 402 | 0,09 |
| 550 000 | ROMANIA 7,125% 23-17/01/2033 | USD | 593 395 | 0,21 | 850 000 | REPUBLIC OF PERU 5,625% 10-18/11/2050 | USD | 885 594 | 0,31 |
| 232 000 | ROMANIA 7,625% 23-17/01/2053 | USD | 259 218 | 0,09 | 2 900 000 | REPUBLIC OF PERU 6,900% 07-12/08/2037 | PEN | 785 860 | 0,27 |
| | <i>Rép. dominicaine</i> | | <i>5 532 866</i> | <i>1,92</i> | 4 430 000 | REPUBLIC OF PERU 6,950% 08-12/08/2031 | PEN | 1 234 266 | 0,43 |
| 124 650 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 11,250% 23-15/09/2035 | DOP | 2 299 734 | 0,80 | 500 000 | REPUBLIC OF PERU 7,350% 05-21/07/2025 | USD | 515 625 | 0,18 |
| 2 463 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 5,875% 20-30/01/2060 | USD | 2 128 032 | 0,74 | | <i>Egypte</i> | | <i>3 999 127</i> | <i>1,38</i> |
| 500 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 6,400% 19-05/06/2049 | USD | 470 000 | 0,16 | 475 000 | ARAB REP EGYPT 5,875% 21-16/02/2031 | USD | 309 938 | 0,11 |
| 600 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 7,450% 14-30/04/2044 | USD | 635 100 | 0,22 | 1 200 000 | ARAB REP EGYPT 7,300% 21-30/09/2033 | USD | 790 125 | 0,27 |
| | <i>Mexique</i> | | <i>5 476 998</i> | <i>1,91</i> | 1 100 000 | ARAB REP EGYPT 7,500% 21-16/02/2061 | USD | 639 719 | 0,22 |
| 32 610 000 | AMERICA MÓVIL SA 9,500% 23-27/01/2031 | MXN | 1 864 688 | 0,65 | 1 200 000 | ARAB REP EGYPT 7,625% 20-29/05/2032 | USD | 830 625 | 0,29 |
| 15 000 000 | MEXICAN BONOS 7,500% 22-26/05/2033 | MXN | 804 833 | 0,28 | 500 000 | ARAB REP EGYPT 7,903% 18-21/02/2048 | USD | 300 156 | 0,10 |
| 11 400 000 | MEXICAN BONOS 7,750% 11-29/05/2031 | MXN | 628 577 | 0,22 | 300 000 | ARAB REP EGYPT 8,150% 19-20/11/2059 | USD | 183 563 | 0,06 |
| 25 500 000 | MEXICAN BONOS 7,750% 12-13/11/2042 | MXN | 1 327 823 | 0,46 | 500 000 | ARAB REP EGYPT 8,500% 17-31/01/2047 | USD | 310 313 | 0,11 |
| 2 000 000 | MEXICAN BONOS 8,000% 23-24/05/2035 | MXN | 107 813 | 0,04 | 1 000 000 | ARAB REP EGYPT 8,875% 20-29/05/2050 | USD | 634 688 | 0,22 |
| 250 000 | MEXICO CITY ARPT 5,500% 17-31/07/2047 | USD | 214 795 | 0,07 | | <i>Hongrie</i> | | <i>3 769 631</i> | <i>1,31</i> |
| 200 000 | UNITED MEXICAN 3,750% 21-19/04/2071 | USD | 133 000 | 0,05 | 70 000 000 | HUNGARY GOVERNMENT 3,000% 18-27/10/2038 | HUF | 141 238 | 0,05 |
| 500 000 | UNITED MEXICAN 4,400% 22-12/02/2052 | USD | 395 469 | 0,14 | 240 000 000 | HUNGARY GOVERNMENT 4,750% 22-24/11/2032 | HUF | 638 868 | 0,22 |
| | <i>Turquie</i> | | <i>4 963 662</i> | <i>1,72</i> | 212 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 0,500% 20-18/11/2030 | EUR | 183 220 | 0,06 |
| 615 000 | HAZINE MUSTESARL 8,509% 23-14/01/2029 | USD | 652 208 | 0,23 | 498 900 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 2,750% 17-22/12/2026 | HUF | 1 310 904 | 0,46 |
| 750 000 | REPUBLIC OF TURKEY 5,750% 17-11/05/2047 | USD | 585 000 | 0,20 | 152 000 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,000% 19-21/08/2030 | HUF | 375 755 | 0,13 |
| 1 250 000 | REPUBLIC OF TURKEY 6,625% 14-17/02/2045 | USD | 1 095 313 | 0,38 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| 88 190 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,000% 20-25/04/2041 | HUF | 171 583 | 0,06 | 975 000 | BAHRAIN 7,500% 17-20/09/2047 | USD | 915 891 | 0,32 |
| 180 000 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,250% 15-22/10/2031 | HUF | 441 513 | 0,15 | 284 000 | BAHRAIN 7,750% 23-18/04/2035 | USD | 296 336 | 0,10 |
| 500 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 5,500% 22-16/06/2034 | USD | 506 550 | 0,18 | 600 000 | OIL & GAS HLDING 7,500% 17-25/10/2027 | USD | 631 500 | 0,22 |
| | <i>Ghana</i> | | <i>3 466 623</i> | <i>1,21</i> | | <i>Russie</i> | | <i>2 711 009</i> | <i>0,94</i> |
| 1 800 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,125% 14-18/01/2026 | USD | 821 813 | 0,29 | 600 000 | RUSSIA - EUROBOND 5,100% 19-28/03/2035 | USD | 246 000 | 0,09 |
| 1 000 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,125% 19-26/03/2032 | USD | 435 000 | 0,15 | 2 400 000 | RUSSIA - EUROBOND 5,250% 17-23/06/2047 | USD | 840 000 | 0,29 |
| 1 600 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,625% 21-07/04/2034 | USD | 688 000 | 0,24 | 440 230 000 | RUSSIA-OFZ 7,650% 19-10/04/2030 | RUB | 1 625 009 | 0,56 |
| 3 552 000 | REPUBLIC OF GHANA 8,750% 20-11/03/2061 | USD | 1 521 810 | 0,53 | | <i>Sénégal</i> | | <i>2 669 907</i> | <i>0,92</i> |
| | <i>Arabie saoudite</i> | | <i>3 176 429</i> | <i>1,10</i> | 1 500 000 | REPUBLIC OF SENEGAL 6,250% 17-23/05/2033 | USD | 1 335 938 | 0,46 |
| 250 000 | SAUDI INT BOND 3,450% 21-02/02/2061 | USD | 175 391 | 0,06 | 1 700 000 | REPUBLIC OF SENEGAL 6,750% 18-13/03/2048 | USD | 1 333 969 | 0,46 |
| 500 000 | SAUDI INT BOND 4,500% 16-26/10/2046 | USD | 441 250 | 0,15 | | <i>Sri Lanka</i> | | <i>2 505 376</i> | <i>0,86</i> |
| 800 000 | SAUDI INT BOND 4,500% 20-22/04/2060 | USD | 690 750 | 0,24 | 600 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,200% 17-11/05/2027 | USD | 300 750 | 0,10 |
| 1 989 000 | SAUDI INT BOND 5,000% 23-18/01/2053 | USD | 1 869 038 | 0,65 | 600 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,750% 18-18/04/2028 | USD | 300 938 | 0,10 |
| | <i>Kenya</i> | | <i>2 973 193</i> | <i>1,03</i> | 200 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,825% 16-18/07/2026 | USD | 102 000 | 0,04 |
| 385 900 000 | KENYA INFRASTRUC 11,750% 19-08/10/2035 | KES | 1 942 693 | 0,67 | 300 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 6,850% 19-14/03/2024 | USD | 150 844 | 0,05 |
| 500 000 | REPUBLIC OF KENYA 8,000% 19-22/05/2032 | USD | 451 250 | 0,16 | 2 700 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 7,550% 19-28/03/2030 | USD | 1 350 844 | 0,47 |
| 700 000 | REPUBLIC OF KENYA 8,250% 18-28/02/2048 | USD | 579 250 | 0,20 | 600 000 | REPUBLIC OF SRI LANKA 7,850% 19-14/03/2029 | USD | 300 000 | 0,10 |
| | <i>Panama</i> | | <i>2 944 597</i> | <i>1,01</i> | | <i>Oman</i> | | <i>2 337 357</i> | <i>0,81</i> |
| 800 000 | PANAMA 3,298% 22-19/01/2033 | USD | 632 500 | 0,22 | 1 000 000 | OMAN INTRNL BOND 6,250% 21-25/01/2031 | USD | 1 050 313 | 0,36 |
| 1 500 000 | PANAMA 3,870% 19-23/07/2060 | USD | 895 781 | 0,31 | 300 000 | OMAN INTRNL BOND 6,500% 17-08/03/2047 | USD | 305 625 | 0,11 |
| 450 000 | PANAMA 4,300% 13-29/04/2053 | USD | 300 516 | 0,10 | 940 000 | OMAN INTRNL BOND 6,750% 18-17/01/2048 | USD | 981 419 | 0,34 |
| 250 000 | PANAMA 4,500% 18-16/04/2050 | USD | 173 125 | 0,06 | | <i>Nigéria</i> | | <i>2 179 423</i> | <i>0,76</i> |
| 486 000 | PANAMA 6,400% 22-14/02/2035 | USD | 473 850 | 0,16 | 800 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 6,500% 17-28/11/2027 | USD | 729 500 | 0,25 |
| 272 000 | PANAMA 6,700% 06-26/01/2036 | USD | 269 450 | 0,09 | 200 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 7,375% 21-28/09/2033 | USD | 170 188 | 0,06 |
| 200 000 | PANAMA 6,875% 23-31/01/2036 | USD | 199 375 | 0,07 | 300 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 8,250% 21-28/09/2051 | USD | 245 813 | 0,09 |
| | <i>Ukraine</i> | | <i>2 922 807</i> | <i>1,03</i> | 1 150 000 | REPUBLIC OF NIGERIA 9,248% 18-21/01/2049 | USD | 1 033 922 | 0,36 |
| 2 300 000 | UKRAINE GOVERNMENT 6,750% 19-20/06/2028 | EUR | 597 063 | 0,21 | | <i>Pologne</i> | | <i>1 987 139</i> | <i>0,69</i> |
| 2 900 000 | UKRAINE GOVERNMENT 6,876% 21-21/05/2031 | USD | 657 031 | 0,23 | 2 800 000 | POLAND GOVERNMENT BOND 1,750% 21-25/04/2032 | PLN | 553 892 | 0,19 |
| 2 200 000 | UKRAINE GOVERNMENT 7,253% 20-15/03/2035 | USD | 510 400 | 0,18 | 1 800 000 | POLAND GOVERNMENT BOND 6,000% 22-25/10/2033 | PLN | 485 123 | 0,17 |
| 2 175 000 | UKRAINE GOVERNMENT 7,375% 17-25/09/2034 | USD | 505 688 | 0,18 | 200 000 | REPUBLIC OF POLAND 4,875% 23-04/10/2033 | USD | 202 150 | 0,07 |
| 2 300 000 | UKRAINE GOVERNMENT 9,750% 18-01/11/2030 | USD | 652 625 | 0,23 | 717 000 | REPUBLIC OF POLAND 5,500% 23-04/04/2053 | USD | 745 974 | 0,26 |
| | <i>Supranational</i> | | <i>2 866 006</i> | <i>1,00</i> | | <i>Tunisie</i> | | <i>1 879 300</i> | <i>0,65</i> |
| 340 000 000 | EURO BK RECON&DV 0,000% 23-10/11/2030 | TRY | 823 119 | 0,29 | 380 000 | BQ CENT TUNISIE 5,750% 15-30/01/2025 | USD | 309 581 | 0,11 |
| 17 000 000 000 | EURO BK RECON&DV 4,250% 21-07/02/2028 | IDR | 1 032 971 | 0,36 | 2 052 000 | TUNISIA INT BOND 6,375% 19-15/07/2026 | EUR | 1 569 719 | 0,54 |
| 1 700 000 | EURO BK RECON&DV 5,680% 22-22/02/2027 | PEN | 456 359 | 0,16 | | <i>Maroc</i> | | <i>1 760 069</i> | <i>0,61</i> |
| 8 600 000 000 | EURO BK RECON&DV 6,000% 23-17/01/2030 | IDR | 553 557 | 0,19 | 1 963 000 | MOROCCO KINGDOM 4,000% 20-15/12/2050 | USD | 1 409 066 | 0,49 |
| | <i>Philippines</i> | | <i>2 743 735</i> | <i>0,95</i> | 333 000 | MOROCCO KINGDOM 6,500% 23-08/09/2033 | USD | 351 003 | 0,12 |
| 217 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 5,000% 23-17/07/2033 | USD | 222 696 | 0,08 | | <i>Bolivie</i> | | <i>1 479 399</i> | <i>0,51</i> |
| 204 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 5,500% 23-17/01/2048 | USD | 214 328 | 0,07 | 2 644 000 | BOLIVIA GOVERNMENT 4,500% 17-20/03/2028 | USD | 1 250 612 | 0,43 |
| 375 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 5,609% 22-13/04/2033 | USD | 399 961 | 0,14 | 421 000 | BOLIVIA GOVERNMENT 7,500% 22-02/03/2030 | USD | 228 787 | 0,08 |
| 800 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 6,375% 09-23/10/2034 | USD | 902 750 | 0,31 | | <i>Angola</i> | | <i>1 441 125</i> | <i>0,50</i> |
| 800 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 9,500% 05-02/02/2030 | USD | 1 004 000 | 0,35 | 500 000 | REPUBLIC OF ANGOLA 8,000% 19-26/11/2029 | USD | 443 750 | 0,15 |
| | <i>Bahreïn</i> | | <i>2 738 140</i> | <i>0,95</i> | 200 000 | REPUBLIC OF ANGOLA 8,750% 22-14/04/2032 | USD | 176 250 | 0,06 |
| 267 000 | BAHRAIN 5,250% 21-25/01/2033 | USD | 237 213 | 0,08 | 700 000 | REPUBLIC OF ANGOLA 9,125% 19-26/11/2049 | USD | 571 375 | 0,20 |
| 500 000 | BAHRAIN 5,625% 21-18/05/2034 | USD | 451 875 | 0,16 | 300 000 | REPUBLIC OF ANGOLA 9,375% 18-08/05/2048 | USD | 249 750 | 0,09 |
| 250 000 | BAHRAIN 6,000% 14-19/09/2044 | USD | 205 325 | 0,07 | | | | | |

Les notes en annexe font partie intégrante de ces états financiers.

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Chine</i> | | <i>1 138 656</i> | <i>0,39</i> | | <i>Trinidad-et-Tobago</i> | | <i>516 250</i> | <i>0,18</i> |
| 7 450 000 | CHINA EVERGRANDE 7,500% 17-31/01/2024 | USD | 74 500 | 0,03 | 500 000 | TRINIDAD & TOBAGO 5,950% 23-14/01/2031 | USD | 516 250 | 0,18 |
| 3 700 000 | CHINA EVERGRANDE 8,250% 17-30/09/2049 | USD | 37 000 | 0,01 | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>496 255</i> | <i>0,17</i> |
| 5 000 000 | CHINA EVERGRANDE 9,500% 19-31/12/2049 | USD | 50 000 | 0,02 | 500 000 | MDC-GMTN B.V. 4,500% 18-07/11/2028 | USD | 496 255 | 0,17 |
| 2 000 000 | CIFI HOLDINGS 6,550% 19-28/03/2024 | USD | 120 000 | 0,04 | | <i>Gabon</i> | | <i>483 073</i> | <i>0,17</i> |
| 4 350 000 | COUNTRY GARDEN 3,125% 20-22/10/2025 | USD | 348 000 | 0,12 | 509 000 | REPUBLIC OF GABON 6,950% 15-16/06/2025 | USD | 483 073 | 0,17 |
| 1 300 000 | COUNTRY GARDEN 3,3.000% 21-12/01/2031 | USD | 97 500 | 0,03 | | <i>Guatemala</i> | | <i>473 000</i> | <i>0,16</i> |
| 500 000 | COUNTRY GARDEN 8,000% 18-27/01/2024 | USD | 37 500 | 0,01 | 500 000 | REPUBLIC OF GUATEMALA 6,125% 19-01/06/2050 | USD | 473 000 | 0,16 |
| 1 900 000 | KWG GROUP 6,300% 20-13/02/2026 | USD | 99 750 | 0,03 | | <i>Côte d'Ivoire</i> | | <i>468 244</i> | <i>0,16</i> |
| 2 200 000 | LOGAN PROPERTY H 6,900% 19-09/06/2024 | USD | 143 000 | 0,05 | 510 000 | IVORY COAST-PDI 6,125% 17-15/06/2033 | USD | 468 244 | 0,16 |
| 92 991 | SUNAC CHINA HLDG 6,000% 23-30/09/2025 | USD | 11 159 | 0,00 | | <i>Mongolie</i> | | <i>419 531</i> | <i>0,15</i> |
| 92 991 | SUNAC CHINA HLDG 6,250% 23-30/09/2026 | USD | 9 532 | 0,00 | 500 000 | MONGOLIA 4,450% 21-07/07/2031 | USD | 419 531 | 0,15 |
| 185 982 | SUNAC CHINA HLDG 6,500% 23-30/09/2027 | USD | 16 273 | 0,01 | | <i>Argentine</i> | | <i>245 383</i> | <i>0,09</i> |
| 278 973 | SUNAC CHINA HLDG 6,750% 23-30/09/2028 | USD | 21 620 | 0,01 | 619 529 | ARGENTINA 1,000% 20-09/07/2029 | USD | 245 383 | 0,09 |
| 278 973 | SUNAC CHINA HLDG 7,000% 23-30/09/2029 | USD | 20 226 | 0,01 | | <i>Ethiopie</i> | | <i>133 000</i> | <i>0,05</i> |
| 131 046 | SUNAC CHINA HLDG 7,250% 23-30/09/2030 | USD | 8 846 | 0,00 | 200 000 | ETHIOPIA 6,625% 14-11/12/2024 | USD | 133 000 | 0,05 |
| 3 500 000 | TIMES CN HLDG 6,750% 20-08/07/2025 | USD | 43 750 | 0,02 | | <i>Uruguay</i> | | <i>97 550</i> | <i>0,03</i> |
| | | | | | 100 000 | URUGUAY 4,975% 18-20/04/2055 | USD | 97 550 | 0,03 |
| | <i>Costa Rica</i> | | <i>1 095 272</i> | <i>0,38</i> | | <i>Irlande</i> | | <i>0</i> | <i>0,00</i> |
| 333 000 | COSTA RICA 6,550% 23-03/04/2034 | USD | 344 822 | 0,12 | 456 000 | GTLK EUROPE DAC 5,125% 17-31/05/2024 | USD | 0 | 0,00 |
| 200 000 | COSTA RICA 7,000% 14-04/04/2044 | USD | 208 500 | 0,07 | | Obligations convertibles | | 20 951 | 0,01 |
| 500 000 | COSTA RICA 7,300% 23-13/11/2054 | USD | 541 950 | 0,19 | | <i>Chine</i> | | <i>20 951</i> | <i>0,01</i> |
| | <i>Salvador</i> | | <i>1 062 520</i> | <i>0,37</i> | 272 755 | SUNAC CHINA HLDG 1,000% 23-30/09/2032 CV | USD | 20 951 | 0,01 |
| 300 000 | EL SALVADOR REP 6,375% 14-18/01/2027 | USD | 263 438 | 0,09 | | Obligations à taux flottant | | 4 903 832 | 1,71 |
| 368 000 | EL SALVADOR REP 7,125% 19-20/01/2050 | USD | 259 785 | 0,09 | | <i>Argentine</i> | | <i>1 940 548</i> | <i>0,68</i> |
| 650 000 | EL SALVADOR REP 9,500% 20-15/07/2052 | USD | 539 297 | 0,19 | 420 611 | ARGENTINA 20-09/01/2038 SR FRN | USD | 165 982 | 0,06 |
| | <i>Hong-Kong</i> | | <i>967 050</i> | <i>0,33</i> | 918 796 | ARGENTINA 20-09/07/2030 SR FRN | USD | 366 875 | 0,13 |
| 1 400 000 | LI & FUNG LTD 5,250% 16-29/12/2049 | USD | 616 000 | 0,21 | 3 458 301 | ARGENTINA 20-09/07/2035 SR FRN | USD | 1 170 566 | 0,41 |
| 1 100 000 | SHIMAO GROUP HOL 3,450% 21-11/01/2031 | USD | 38 500 | 0,01 | 700 000 | ARGENTINA 20-09/07/2041 SR FRN | USD | 237 125 | 0,08 |
| 8 930 000 | SHIMAO GROUP HOL 5,600% 19-15/07/2026 | USD | 312 550 | 0,11 | | <i>Mexique</i> | | <i>1 909 800</i> | <i>0,66</i> |
| | <i>Qatar</i> | | <i>825 585</i> | <i>0,29</i> | 1 800 000 | CEMEX SAB 23-14/06/2171 FRN | USD | 1 909 800 | 0,66 |
| 500 000 | QATAR PETROLEUM 3,300% 21-12/07/2051 | USD | 364 300 | 0,13 | | <i>Equateur</i> | | <i>1 053 484</i> | <i>0,37</i> |
| 500 000 | STATE OF QATAR 4,400% 20-16/04/2050 | USD | 461 285 | 0,16 | 191 600 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2030 SR FRN | USD | 88 711 | 0,03 |
| | <i>Cameroun</i> | | <i>730 415</i> | <i>0,25</i> | 358 407 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2030 SR FRN | USD | 101 608 | 0,04 |
| 900 000 | REPUBLIC OF CAMEROON 5,950% 21-07/07/2032 | EUR | 730 415 | 0,25 | 1 423 680 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2035 SR FRN | USD | 504 695 | 0,18 |
| | <i>Zambie</i> | | <i>723 281</i> | <i>0,25</i> | 1 138 000 | REPUBLIC OF ECUADOR 20-31/07/2040 SR FRN | USD | 358 470 | 0,12 |
| 1 300 000 | REPUBLIC OF ZAMBIA 5,375% 12-31/12/2099 | USD | 723 281 | 0,25 | | Autres valeurs mobilières | | 671 428 | 0,23 |
| | <i>Paraguay</i> | | <i>684 600</i> | <i>0,23</i> | | Obligations | | 671 428 | 0,23 |
| 400 000 | PARAGUAY 2,739% 21-29/01/2033 | USD | 328 000 | 0,11 | | <i>Venezuela</i> | | <i>474 959</i> | <i>0,16</i> |
| 400 000 | PARAGUAY 5,400% 19-30/03/2050 | USD | 356 600 | 0,12 | 3 370 000 | VENEZUELA 0,000% 07-31/03/2038 DFLT | USD | 474 959 | 0,16 |
| | <i>Kazakhstan</i> | | <i>563 250</i> | <i>0,20</i> | | <i>Liban</i> | | <i>112 219</i> | <i>0,04</i> |
| 600 000 | KAZMUNAYGAS NAT 6,375% 18-24/10/2048 | USD | 563 250 | 0,20 | 1 900 000 | REPUBLIC OF LEBANON 6,600% 11-27/11/2026 DFLT | USD | 112 219 | 0,04 |
| | <i>Emirats Arabes Unis</i> | | <i>548 971</i> | <i>0,19</i> | | <i>Chine</i> | | <i>63 250</i> | <i>0,02</i> |
| 650 000 | DP WORLD PLC 4,700% 19-30/09/2049 | USD | 548 971 | 0,19 | 1 100 000 | CHINA SCE GRP 7,000% 20-02/05/2025 DFLT | USD | 63 250 | 0,02 |
| | <i>Ouzbékistan</i> | | <i>522 188</i> | <i>0,18</i> | | <i>Iles Vierges britanniques</i> | | <i>21 000</i> | <i>0,01</i> |
| 500 000 | UZBEK INTL BOND 7,850% 23-12/10/2028 | USD | 522 188 | 0,18 | 2 100 000 | SCENERY JOURNEY 13,750% 18-06/11/2099 DFLT | USD | 21 000 | 0,01 |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Instruments du marché monétaire | | | 37 871 895 | 13,16 |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 5 000 000 | US TREASURY BILL 0,000% 23-13/06/2024 | USD | 4 885 220 | 1,70 |
| 6 000 000 | US TREASURY BILL 0,000% 23-15/02/2024 | USD | 5 961 462 | 2,07 |
| 12 000 000 | US TREASURY BILL 0,000% 23-16/05/2024 | USD | 11 769 599 | 4,09 |
| 12 000 000 | US TREASURY BILL 0,000% 23-30/05/2024 | USD | 11 747 941 | 4,08 |
| <i>Egypte</i> | | | | |
| 136 000 000 | EGYPT T-BILL 0,000% 23-03/12/2024 | EGP | 3 507 673 | 1,22 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 25 580 666 | 8,88 |
| <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 10 835,00 | BNP PARIBAS FUNDS RMB BOND - X CAP | USD | 13 430 740 | 4,66 |
| 28,00 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ASIAN CITIES BOND - X CAP | USD | 2 917 439 | 1,01 |
| 65 634,21 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D I VNAV - X CAP | USD | 9 232 487 | 3,21 |
| Total portefeuille-titres | | | 271 376 088 | 94,22 |

BNP PARIBAS FUNDS Emerging Markets Climate Solutions

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | | | | | |
| 148 202 | BYD CO LTD-H | HKD | 4 086 080 | 3,33 | 27 368 | ALKHORAYEF WATER & POWER TEC | SAR | 1 415 834 | 1,15 |
| 4 379 507 | CHINA THREE GORGES RENEWAB-A | CNY | 2 699 324 | 2,20 | 23 269 | QUIMICA Y MINERA CHIL - ADR | USD | 1 401 259 | 1,14 |
| 162 439 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | CNY | 3 744 009 | 3,05 | 751 802 | ENERGY ABSOLUTE PCL-FOREIGN | THB | 974 649 | 0,79 |
| 150 430 | DAQO NEW ENERGY CORP - ADR | USD | 4 001 438 | 3,26 | <i>Thaïlande</i> | | | | |
| 581 750 | GANFENG LITHIUM CO LTD-H | HKD | 2 201 614 | 1,79 | 292 562 | SAPPI LTD | ZAR | 707 108 | 0,58 |
| 904 400 | HONGFA TECHNOLOGY CO LTD - A | CNY | 3 525 122 | 2,87 | <i>Afrique du Sud</i> | | | | |
| 76 644 | LI AUTO INC-CLASS A | HKD | 1 442 543 | 1,18 | 2 642 126 | | | | |
| 491 756 | LONGI GREEN ENERGY TECHNOL - A | CNY | 1 589 165 | 1,29 | 2,15 | | | | |
| 1 637 535 | MING YANG SMART ENERGY GRO - A | CNY | 2 895 592 | 2,36 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 970 000 | NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | CNY | 3 053 284 | 2,49 | 18 783,00 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D 1 VNAV - X CAP | USD | 2 642 126 | 2,15 |
| 164 910 | NINGBO ORIENT WIRES & CABL - A | CNY | 994 337 | 0,81 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 149 100 | SUNGROW POWER SUPPLY CO LT-A | CNY | 1 843 945 | 1,50 | 122 441 359 | | | | |
| 905 105 | WUXI LEAD INTELLIGENT EQUI - A | CNY | 3 268 618 | 2,66 | 99,76 | | | | |
| 8 627 367 | XINYI ENERGY HOLDINGS LTD | HKD | 1 581 433 | 1,29 | | | | | |
| 6 978 310 | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | HKD | 4 088 656 | 3,33 | | | | | |
| 1 404 696 | ZHUZHOU CRRC TIMES ELECTRIC | HKD | 4 015 522 | 3,27 | | | | | |
| <i>Inde</i> | | | | | | | | | |
| 17 760 | KEI INDUSTRIES LTD | INR | 694 067 | 0,57 | | | | | |
| 333 693 | RENEW ENERGY GLOBAL PLC-A | USD | 2 556 088 | 2,08 | | | | | |
| 564 464 | STERLING AND WILSON RENEWABL | INR | 2 933 728 | 2,39 | | | | | |
| 639 990 | TATA TECHNOLOGIES CO | INR | 9 076 438 | 7,40 | | | | | |
| <i>Corée du Sud</i> | | | | | | | | | |
| 34 385 | DOOSAN FUEL CELL CO LTD | KRW | 619 559 | 0,50 | | | | | |
| 29 053 | HYUNDAI MOTOR CO | KRW | 4 591 431 | 3,75 | | | | | |
| 11 414 | LG CHEM LTD | KRW | 4 421 087 | 3,60 | | | | | |
| 12 403 | SAMSUNG SDI CO LTD | KRW | 4 547 193 | 3,71 | | | | | |
| 16 620 | SK IE TECHNOLOGY CO LTD | KRW | 1 018 452 | 0,83 | | | | | |
| <i>Taiwan</i> | | | | | | | | | |
| 24 445 | ADVANCED ENERGY SOLUTION HOL | TWD | 599 626 | 0,49 | | | | | |
| 476 087 | GIANT MANUFACTURING | TWD | 2 853 997 | 2,33 | | | | | |
| 2 985 277 | TAIWAN HIGH SPEED RAIL CORP | TWD | 2 986 285 | 2,43 | | | | | |
| 424 397 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 8 191 357 | 6,68 | | | | | |
| <i>Brésil</i> | | | | | | | | | |
| 72 471 | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | BRL | 1 124 452 | 0,92 | | | | | |
| 404 230 | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | BRL | 2 972 474 | 2,42 | | | | | |
| 547 587 | KLABIN SA - UNIT | BRL | 2 504 813 | 2,04 | | | | | |
| 3 501 567 | RAIZEN SA - PREFERENCE | BRL | 2 904 996 | 2,37 | | | | | |
| 239 278 | RUMO SA | BRL | 1 130 482 | 0,92 | | | | | |
| 310 693 | SERENA ENERGIA SA | BRL | 653 033 | 0,53 | | | | | |
| <i>Mexique</i> | | | | | | | | | |
| 1 638 007 | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | MXN | 3 638 832 | 2,96 | | | | | |
| <i>Grèce</i> | | | | | | | | | |
| 205 458 | TERNA ENERGY SA | EUR | 3 608 651 | 2,94 | | | | | |
| <i>Hong-Kong</i> | | | | | | | | | |
| 8 938 946 | BEIJING ENTERPRISES WATER GR | HKD | 1 993 445 | 1,62 | | | | | |
| 1 285 490 | CHINA WATER AFFAIRS GROUP | HKD | 706 509 | 0,58 | | | | | |
| <i>Australie</i> | | | | | | | | | |
| 299 098 | ALLKEM LTD | AUD | 2 063 133 | 1,68 | | | | | |
| <i>Indonésie</i> | | | | | | | | | |
| 24 724 500 | PERTAMINA GEOTHERMAL ENERGY | IDR | 1 879 573 | 1,53 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Energy Transition

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|-------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | 1 406 223 684 97,27 | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | <i>811 651 195 56,13</i> | | | | |
| 3 800 000 | ADVENT TECHNOLOGIES HOLDINGS | USD | 766 433 | 0,05 | 2 199 738 | AGILYX AS | NOK | 4 666 735 | 0,32 |
| 519 266 | ALBEMARLE CORP | USD | 67 916 129 | 4,70 | 10 268 022 | AKER CARBON CAPTURE AS | NOK | 12 429 446 | 0,86 |
| 704 592 | AMERESCO INC - A | USD | 20 200 451 | 1,40 | 4 778 991 | OTOVO AS - A SHARES | NOK | 1 437 723 | 0,10 |
| 5 101 042 | ARRAY TECHNOLOGIES INC | USD | 77 578 876 | 5,37 | <i>Italie</i> | | | | |
| 3 879 275 | BLOOM ENERGY CORP- A | USD | 51 974 173 | 3,60 | 937 536 | INDUSTRIE DE NORA SPA | EUR | 14 709 940 | 1,02 |
| 594 518 | DARLING INGREDIENTS INC | USD | 26 823 679 | 1,86 | 88 582 | PRYSMIAN SPA | EUR | 3 646 921 | 0,25 |
| 2 000 000 | ELECTRIC LAST MILE SOLUTIONS | USD | 148 463 | 0,01 | <i>Australie</i> | | | | |
| 221 544 | FIRST SOLAR INC | USD | 34 551 759 | 2,39 | 1 213 917 | ALLKEM LTD | AUD | 7 580 153 | 0,52 |
| 3 362 526 | FLUENCE ENERGY INC | USD | 72 598 783 | 5,02 | 31 741 048 | QUEENSLAND PACIFIC METALS LT | AUD | 1 076 380 | 0,07 |
| 584 331 | GREEN PLAINS INC | USD | 13 340 721 | 0,92 | 189 863 655 | SAYONA MINING LTD | AUD | 8 320 154 | 0,58 |
| 594 379 | HANNON ARMSTRONG SUSTAINABLE | USD | 14 839 970 | 1,03 | <i>Brésil</i> | | | | |
| 1 462 496 | LIVENT CORP | USD | 23 804 534 | 1,65 | 19 732 556 | RAIZEN SA - PREFERENCE | BRL | 14 819 780 | 1,03 |
| 495 716 | NEXTRACKER INC - A | USD | 21 024 120 | 1,45 | <i>Israël</i> | | | | |
| 600 000 | ORIGIN MATERIALS INC | USD | 454 189 | 0,03 | 841 293 | ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD | USD | 14 576 878 | 1,01 |
| 212 683 | ORMAT TECHNOLOGIES INC | USD | 14 592 174 | 1,01 | <i>Corée du Sud</i> | | | | |
| 6 500 000 | PLUG POWER INC | USD | 26 478 975 | 1,83 | 30 318 | SAMSUNG SDI CO LTD | KRW | 10 062 190 | 0,70 |
| 3 455 392 | QUANTUMSCAPE CORP | USD | 21 739 894 | 1,50 | <i>France</i> | | | | |
| 3 547 123 | SHOALS TECHNOLOGIES GROUP - A | USD | 49 900 232 | 3,45 | 224 551 | NEOEN SA | EUR | 6 799 404 | 0,47 |
| 6 526 173 | STEM INC | USD | 22 922 692 | 1,59 | <i>Suède</i> | | | | |
| 10 388 423 | SUNNOVA ENERGY INTERNATIONAL | USD | 143 415 063 | 9,91 | 783 882 | OX2 AB | SEK | 3 862 199 | 0,27 |
| 5 336 427 | SUNRUN INC | USD | 94 830 093 | 6,55 | <i>Bahamas</i> | | | | |
| 48 128 | TESLA INC | USD | 10 825 914 | 0,75 | 70 566 | LOCAL BOUNTY CORP | USD | 132 233 | 0,01 |
| 280 374 | VIEW INC | USD | 923 878 | 0,06 | Autres valeurs mobilières | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | 0 0,00 | | | | |
| 1 287 614 | NORDEX SE | EUR | 13 391 186 | 0,93 | Warrants, droits | | | | |
| 5 207 103 | SIEMENS ENERGY AG | EUR | 62 485 236 | 4,32 | 2 500 000 | QUEENSLAND PACIFIC MET LTD CW 18/10/2026 | AUD | 0 | 0,00 |
| 4 146 132 | THYSSENKRUPP NUCERA AG & CO | EUR | 76 496 135 | 5,29 | Total portefeuille-titres | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | 1 406 223 684 97,27 | | | | |
| 1 654 500 | BYD CO LTD-H | HKD | 41 294 758 | 2,86 | | | | | |
| 2 135 444 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | CNY | 44 556 401 | 3,08 | | | | | |
| <i>Inde</i> | | | | | | | | | |
| 10 000 000 | RENEW ENERGY GLOBAL PLC-A | USD | 69 343 231 | 4,80 | | | | | |
| 2 092 630 | STERLING AND WILSON RENEWABL | INR | 9 845 807 | 0,68 | | | | | |
| 44 791 | TATA TECHNOLOGIES CO | INR | 575 054 | 0,04 | | | | | |
| <i>Espagne</i> | | | | | | | | | |
| 563 000 | CORP ACCIONA ENERGIAS RENOVA | EUR | 15 809 040 | 1,09 | | | | | |
| 1 757 825 | EDP RENOVAVEIS SA | EUR | 32 563 708 | 2,25 | | | | | |
| <i>Danemark</i> | | | | | | | | | |
| 2 344 405 | CADELER A/S | NOK | 9 805 186 | 0,68 | | | | | |
| 1 250 210 | VESTAS WIND SYSTEMS A/S | DKK | 35 940 466 | 2,49 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | | | | | |
| 131 369 813 | MEYER BURGER TECHNOLOGY AG | CHF | 27 624 824 | 1,91 | | | | | |
| <i>Canada</i> | | | | | | | | | |
| 565 788 | ANAERGIA INC | CAD | 97 108 | 0,01 | | | | | |
| 8 580 251 | FORAN MINING CORPORATION | CAD | 22 973 348 | 1,59 | | | | | |
| 8 444 639 | LI-CYCLE HOLDINGS CORP | USD | 4 470 579 | 0,31 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 9 121 311 | CERES POWER HOLDINGS PLC | GBP | 19 241 540 | 1,33 | | | | | |
| 1 925 193 | POLESTAR AUTOMOTIVE-CL A ADS | USD | 3 938 746 | 0,27 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Enhanced Bond 6M

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|----------------------|-------------------|------------------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | | | 2 126 389 528 | 93,06 | | | | | |
| Obligations | | | 1 641 584 843 | 71,82 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 11 000 000 | AIR FRANCE-KLM 7,250% 23-31/05/2026 | EUR | 11 719 780 | 0,51 | 3 500 000 | RENAULT 2,375% 20-25/05/2026 | EUR | 3 382 849 | 0,15 |
| 5 000 000 | ALD SA 4,750% 22-13/10/2025 | EUR | 5 094 938 | 0,22 | 7 143 000 | REKEL SA 2,125% 21-15/12/2028 | EUR | 6 641 151 | 0,29 |
| 4 900 000 | ALSTOM S 0,000% 21-11/01/2029 | EUR | 4 022 117 | 0,18 | 15 300 000 | SOCIETE GENERALE 1,125% 18-23/01/2025 | EUR | 14 865 285 | 0,65 |
| 2 700 000 | AUCHAN SA 2,375% 19-25/04/2025 | EUR | 2 634 481 | 0,12 | 10 000 000 | SOCIETE GENERALE 1,250% 19-15/02/2024 | EUR | 9 965 187 | 0,44 |
| 5 600 000 | AUCHAN SA 3,250% 20-23/07/2027 | EUR | 5 427 921 | 0,24 | 3 564 000 | TEREOS FIN GROUP 7,250% 23-15/04/2028 | EUR | 3 769 862 | 0,16 |
| 10 000 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,010% 21-07/03/2025 | EUR | 9 578 312 | 0,42 | 1 500 000 | TEREOS FIN GROUP 7,500% 20-30/10/2025 | EUR | 1 527 413 | 0,07 |
| 7 400 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 1,875% 16-04/11/2026 | EUR | 7 067 265 | 0,31 | 10 900 000 | THALES SA 4,000% 23-18/10/2025 | EUR | 11 042 126 | 0,48 |
| 7 200 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 2,375% 16-24/03/2026 | EUR | 7 032 805 | 0,31 | 5 500 000 | VALEO SA 1,500% 18-18/06/2025 | EUR | 5 303 500 | 0,23 |
| 20 960 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 3,000% 14-21/05/2024 | EUR | 20 858 646 | 0,91 | 7 000 000 | VALEO SA 3,250% 14-22/01/2024 | EUR | 6 989 692 | 0,31 |
| 22 500 000 | BNP PARIBAS 1,000% 17-29/11/2024 | EUR | 21 847 457 | 0,96 | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 23 000 000 | BNP PARIBAS 2,375% 15-17/02/2025 | EUR | 22 659 682 | 0,99 | 5 198 000 | ABBVIE INC 1,250% 20-01/06/2024 | EUR | 5 138 654 | 0,22 |
| 1 000 000 | BNP PARIBAS 2,750% 15-27/01/2026 | EUR | 990 387 | 0,04 | 7 775 000 | AT&T INC 0,250% 19-04/03/2026 | EUR | 7 294 608 | 0,32 |
| 19 500 000 | BPCE 0,625% 19-26/09/2024 | EUR | 19 027 550 | 0,83 | 6 000 000 | BAXTER INTERNATIONAL 0,400% 19-15/05/2024 | EUR | 5 918 766 | 0,26 |
| 8 700 000 | CAISSE NATIONALE REASSURANCE MUTUELLE 3,375% 18-24/09/2028 | EUR | 8 630 723 | 0,38 | 4 598 000 | BOOKING HLDS INC 0,100% 21-08/03/2025 | EUR | 4 418 348 | 0,19 |
| 9 200 000 | CARMILA SA 1,625% 20-30/05/2027 | EUR | 8 483 792 | 0,37 | 21 500 000 | DANAHER CORP 1,700% 20-30/03/2024 | EUR | 21 366 808 | 0,94 |
| 15 000 000 | CARMILA SA 1,625% 21-01/04/2029 | EUR | 12 943 428 | 0,57 | 5 000 000 | EASTMAN CHEMICAL 1,875% 16-23/11/2026 | EUR | 4 788 383 | 0,21 |
| 8 000 000 | CARMILA SA 5,500% 23-09/10/2028 | EUR | 8 295 176 | 0,36 | 4 900 000 | FORD MOTOR CREDIT 1,744% 20-19/07/2024 | EUR | 4 824 906 | 0,21 |
| 9 500 000 | CARREFOUR BANQUE 0,107% 21-14/06/2025 | EUR | 9 039 994 | 0,40 | 10 950 000 | FORD MOTOR CREDIT 3,021% 19-06/03/2024 | EUR | 10 906 291 | 0,48 |
| 8 900 000 | CARREFOUR BANQUE 4,079% 23-05/05/2027 | EUR | 9 029 180 | 0,40 | 6 109 000 | FORD MOTOR CREDIT 4,867% 23-03/08/2027 | EUR | 6 278 094 | 0,27 |
| 700 000 | CIE FIN FONCIER 0,375% 17-11/12/2024 | EUR | 679 978 | 0,03 | 12 000 000 | GENERAL ELECTRIC CO 0,875% 17-17/05/2025 | EUR | 11 590 148 | 0,51 |
| 11 300 000 | CNP ASSURANCES 0,375% 20-08/03/2028 | EUR | 9 932 965 | 0,43 | 2 853 000 | HONEYWELL INTERNATIONAL 0,000% 20-10/03/2024 | EUR | 2 831 506 | 0,12 |
| 3 400 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 5,875% 23-25/10/2033 | EUR | 3 726 876 | 0,16 | 14 340 000 | INTERNATIONAL FLAVORS 1,750% 16-14/03/2024 | EUR | 14 263 387 | 0,62 |
| 16 600 000 | CREDIT AGRICOLE SA 2,800% 15-16/10/2025 | EUR | 16 296 610 | 0,71 | 13 000 000 | MYLAN INC 2,125% 18-23/05/2025 | EUR | 12 678 787 | 0,55 |
| 3 000 000 | CREDIT AGRICOLE SA 3,000% 15-21/12/2025 | EUR | 2 947 194 | 0,13 | 24 900 000 | MYLAN NV 2,250% 16-22/11/2024 | EUR | 24 453 880 | 1,07 |
| 2 000 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 1,250% 17-31/05/2024 | EUR | 1 976 586 | 0,09 | 8 100 000 | STRYKER CORP 0,250% 19-03/12/2024 | EUR | 7 841 183 | 0,34 |
| 1 000 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 3,250% 16-01/06/2026 | EUR | 1 000 672 | 0,04 | 4 619 000 | THERMO FISHER 0,125% 19-01/03/2025 | EUR | 4 439 828 | 0,19 |
| 4 200 000 | CTE CO TRANSP EL 0,875% 17-29/09/2024 | EUR | 4 104 141 | 0,18 | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 8 000 000 | EENREED 3,625% 23-13/12/2026 | EUR | 8 104 385 | 0,35 | 5 100 000 | ABN AMRO BANK NV 1,250% 20-28/05/2025 | EUR | 4 940 178 | 0,22 |
| 11 900 000 | ELEC DE FRANCE 4,625% 09-11/09/2024 | EUR | 11 954 900 | 0,52 | 13 000 000 | ABN AMRO BANK NV 3,750% 23-20/04/2025 | EUR | 13 044 790 | 0,57 |
| 10 000 000 | EUTELSAT SA 2,000% 18-02/10/2025 | EUR | 9 390 053 | 0,41 | 4 300 000 | DAMLER TRUCK 3,875% 23-19/06/2026 | EUR | 4 370 397 | 0,19 |
| 2 400 000 | FAURECIA 7,250% 22-15/06/2026 | EUR | 2 539 825 | 0,11 | 4 739 000 | ENBW INTERNATIONAL FIN 4,875% 04-16/01/2025 | EUR | 4 798 255 | 0,21 |
| 2 238 000 | FNAC DARTY SA 1,875% 19-30/05/2024 | EUR | 2 203 998 | 0,10 | 32 252 000 | HEIMSTADEN BOST 0,250% 21-13/10/2024 | EUR | 30 336 101 | 1,33 |
| 11 000 000 | GROUPAMA SA 6,000% 17-23/01/2027 | EUR | 11 809 109 | 0,52 | 4 846 000 | LEASEPLAN CORP 0,250% 21-23/02/2026 | EUR | 4 511 084 | 0,20 |
| 5 000 000 | ICADE 1,125% 16-17/11/2025 | EUR | 4 755 999 | 0,21 | 7 300 000 | NIBC BANK NV 6,375% 23-01/12/2025 | EUR | 7 628 981 | 0,33 |
| 22 600 000 | IMERYS SA 2,000% 14-10/12/2024 | EUR | 22 135 133 | 0,97 | 9 900 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 0,125% 20-05/10/2024 | EUR | 9 631 484 | 0,42 |
| 11 900 000 | JCDECAUX SA 2,000% 20-24/10/2024 | EUR | 11 702 397 | 0,51 | 6 355 000 | SCHLUMBERGER FIN 0,000% 19-15/10/2024 | EUR | 6 162 332 | 0,27 |
| 5 000 000 | LA MONDIALE 0,750% 20-20/04/2026 | EUR | 4 682 891 | 0,20 | 10 000 000 | VOLKSBANK NV 0,010% 19-16/09/2024 | EUR | 9 727 205 | 0,43 |
| 6 200 000 | MERCIALYS 1,800% 18-27/02/2026 | EUR | 5 916 518 | 0,26 | 4 900 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,125% 22-28/03/2025 | EUR | 4 866 110 | 0,21 |
| 5 100 000 | MERCIALYS 4,625% 20-07/07/2027 | EUR | 5 020 939 | 0,22 | 7 000 000 | VOLKSWAGEN INTFN 4,125% 22-15/11/2025 | EUR | 7 083 646 | 0,31 |
| 11 700 000 | NEXANS SA 2,750% 17-05/04/2024 | EUR | 11 615 328 | 0,51 | 6 600 000 | VONOVIA BV 1,250% 16-06/12/2024 | EUR | 6 428 158 | 0,28 |
| 4 900 000 | ORANO SA 3,375% 19-23/04/2026 | EUR | 4 850 249 | 0,21 | 4 000 000 | WINTERSHALL FIN 0,840% 19-25/09/2025 | EUR | 3 802 831 | 0,17 |
| 3 600 000 | PRAEMIA HEALTHCR 5,500% 23-19/09/2028 | EUR | 3 764 022 | 0,16 | <i>Italie</i> | | | | |
| 5 000 000 | PSA BANQUE FRANC 0,625% 19-21/06/2024 | EUR | 4 920 301 | 0,22 | 4 193 000 | ACEA SPA 0,000% 21-28/09/2025 | EUR | 3 948 565 | 0,17 |
| 2 800 000 | PSA BANQUE FRANC 3,875% 23-19/01/2026 | EUR | 2 818 618 | 0,12 | 10 000 000 | ACQUIRENTE UNI 2,800% 19-20/02/2026 | EUR | 9 793 492 | 0,43 |
| 4 925 000 | RCI BANQUE 0,500% 22-14/07/2025 | EUR | 4 698 918 | 0,21 | 14 700 000 | AUTOSTRADA PER L 1,875% 15-04/11/2025 | EUR | 14 234 643 | 0,62 |
| 16 200 000 | RCI BANQUE 1,625% 17-11/04/2025 | EUR | 15 800 487 | 0,69 | 6 850 000 | BANCO BPM SPA 6,000% 22-13/09/2026 | EUR | 7 213 850 | 0,32 |
| 5 530 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-02/10/2026 | EUR | 5 668 697 | 0,25 | 15 613 000 | INTESA SANPAOLO 2,125% 20-26/05/2025 | EUR | 15 294 525 | 0,67 |
| 17 000 000 | RENAULT 1,250% 19-24/06/2025 | EUR | 16 294 476 | 0,71 | 17 816 000 | POSTE ITALIANE 0,000% 20-10/12/2024 | EUR | 17 182 169 | 0,75 |
| | | | | | 4 370 000 | TIM SPA 4,000% 19-11/04/2024 | EUR | 4 344 755 | 0,19 |

BNP PARIBAS FUNDS Enhanced Bond 6M

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 12 400 000 | UNICREDIT SPA 0,500% 19-09/04/2025 | EUR | 11 911 113 | 0,52 | | | | | |
| 10 672 000 | UNIONE DI BANCHE 1,625% 19-21/04/2025 | EUR | 10 406 036 | 0,46 | | | | | |
| 9 000 000 | UNIONE DI BANCHE 2,625% 19-20/06/2024 | EUR | 8 929 849 | 0,39 | | | | | |
| 10 000 000 | UNIPOL GRUPPO 3,000% 15-18/03/2025 | EUR | 9 866 017 | 0,43 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>111 907 831</i> | <i>4,88</i> | | | | | |
| 3 100 000 | ABERTIS INFRAEST 0,625% 19-15/07/2025 | EUR | 2 966 657 | 0,13 | | | | | |
| 8 800 000 | ABERTIS INFRAEST 1,125% 19-26/03/2028 | EUR | 8 056 369 | 0,35 | | | | | |
| 21 400 000 | ARVAL SERVICE 0,000% 21-30/09/2024 | EUR | 20 721 561 | 0,91 | | | | | |
| 8 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 0,375% 19-02/10/2024 | EUR | 7 794 986 | 0,34 | | | | | |
| 8 400 000 | BANCO SABADELL 1,125% 19-27/03/2025 | EUR | 8 131 833 | 0,36 | | | | | |
| 4 000 000 | BANCO SABADELL 2,500% 21-15/04/2031 | EUR | 3 770 160 | 0,16 | | | | | |
| 9 000 000 | BANCO SANTANDER 2,125% 18-08/02/2028 | EUR | 8 519 723 | 0,37 | | | | | |
| 10 500 000 | CAIXABANK 0,625% 19-01/10/2024 | EUR | 10 247 466 | 0,45 | | | | | |
| 3 300 000 | CAIXABANK 2,375% 19-01/02/2024 | EUR | 3 294 940 | 0,14 | | | | | |
| 6 500 000 | COMUNIDAD MADRID 4,125% 14-21/05/2024 | EUR | 6 494 573 | 0,28 | | | | | |
| 1 800 000 | FERROVIAL EMISIO 0,540% 20-12/11/2028 | EUR | 1 595 688 | 0,07 | | | | | |
| 11 700 000 | KUTXABANK 0,500% 19-25/09/2024 | EUR | 11 414 301 | 0,50 | | | | | |
| 2 000 000 | MERLIN PROPERTIES 1,750% 17-26/05/2025 | EUR | 1 942 046 | 0,08 | | | | | |
| 12 200 000 | SANTANDER ISSUAN 2,500% 15-18/03/2025 | EUR | 11 991 757 | 0,52 | | | | | |
| 5 000 000 | SANTANDER ISSUAN 3,250% 16-04/04/2026 | EUR | 4 965 771 | 0,22 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>104 953 742</i> | <i>4,59</i> | | | | | |
| 17 000 000 | ALSTRIA OFFICE 0,500% 19-26/09/2025 | EUR | 14 639 718 | 0,64 | | | | | |
| 5 000 000 | BAYER AG 0,050% 21-12/01/2025 | EUR | 4 804 997 | 0,21 | | | | | |
| 8 810 000 | COMMERZBANK AG 0,625% 19-28/08/2024 | EUR | 8 618 395 | 0,38 | | | | | |
| 15 225 000 | COMMERZBANK AG 4,000% 16-23/03/2026 | EUR | 15 249 781 | 0,67 | | | | | |
| 6 667 000 | CONTINENTAL AG 4,000% 23-01/03/2027 | EUR | 6 815 788 | 0,30 | | | | | |
| 4 016 000 | CONTINENTAL AG 4,000% 23-01/06/2028 | EUR | 4 144 037 | 0,18 | | | | | |
| 8 400 000 | DT LUFTHANSA AG 2,875% 21-11/02/2025 | EUR | 8 232 006 | 0,36 | | | | | |
| 6 154 000 | FRESENIUS SE & C 1,875% 22-24/05/2025 | EUR | 6 015 796 | 0,26 | | | | | |
| 5 900 000 | LANXESS 1,125% 18-16/05/2025 | EUR | 5 690 026 | 0,25 | | | | | |
| 7 900 000 | ROBERT BOSCH 3,625% 23-02/06/2027 | EUR | 8 063 594 | 0,35 | | | | | |
| 8 000 000 | SCHAEFFLER AG 2,750% 20-12/10/2025 | EUR | 7 836 578 | 0,34 | | | | | |
| 12 000 000 | VOLKSWAGEN BANK 1,250% 18-10/06/2024 | EUR | 11 849 563 | 0,52 | | | | | |
| 3 000 000 | VOLKSWAGEN BANK 1,875% 19-31/01/2024 | EUR | 2 993 463 | 0,13 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>104 726 480</i> | <i>4,59</i> | | | | | |
| 10 900 000 | ASB FINANCE LTD 0,750% 18-09/10/2025 | EUR | 10 445 572 | 0,46 | | | | | |
| 15 500 000 | DS SMITH PLC 1,375% 17-26/07/2024 | EUR | 15 264 684 | 0,67 | | | | | |
| 17 000 000 | HEATHROW FNDG 1,500% 20-12/10/2025 | EUR | 16 446 389 | 0,72 | | | | | |
| 3 400 000 | INTERNATIONAL CONSOLIDAT 2,750% 21-25/03/2025 | EUR | 3 331 335 | 0,15 | | | | | |
| 4 100 000 | NATWEST MARKETS 1,000% 19-28/05/2024 | EUR | 4 049 967 | 0,18 | | | | | |
| 13 105 000 | ROLLS-ROYCE PLC 0,875% 18-09/05/2024 | EUR | 12 905 780 | 0,56 | | | | | |
| 18 175 000 | STANDARD CHARTERED 3,125% 14-19/11/2024 | EUR | 18 006 913 | 0,79 | | | | | |
| 6 969 000 | TESCO CORP TREAS 0,875% 19-29/05/2026 | EUR | 6 591 328 | 0,29 | | | | | |
| 7 528 000 | TESCO CORP TREAS 4,250% 23-27/02/2031 | EUR | 7 816 504 | 0,34 | | | | | |
| 10 000 000 | YORKSHIRE BLD SOC 0,125% 19-08/05/2024 | EUR | 9 868 008 | 0,43 | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | | | | | | <i>63 987 584</i> | <i>2,79</i> |
| 10 900 000 | AROUNDTOWN SA 0,000% 20-16/07/2026 | EUR | 9 130 354 | 0,40 | | | | | |
| 1 000 000 | AROUNDTOWN SA 1,000% 17-07/01/2025 | EUR | 952 167 | 0,04 | | | | | |
| 10 943 000 | CNH INDUSTRIAL FIN 0,000% 20-01/04/2024 | EUR | 10 832 334 | 0,47 | | | | | |
| 13 886 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 2,125% 17-25/07/2024 | EUR | 13 704 736 | 0,60 | | | | | |
| 2 546 000 | HEIDELCEMENT FIN 2,500% 20-09/10/2024 | EUR | 2 519 210 | 0,11 | | | | | |
| 2 700 000 | LOGICOR FIN 0,625% 22-17/11/2025 | EUR | 2 514 176 | 0,11 | | | | | |
| 24 933 000 | LOGICOR FIN 0,750% 19-15/07/2024 | EUR | 24 334 607 | 1,06 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | | | | | | <i>62 712 066</i> | <i>2,76</i> |
| 8 262 000 | AIB GROUP PLC 1,250% 19-28/05/2024 | EUR | 8 168 497 | 0,36 | | | | | |
| 6 400 000 | AIB GROUP PLC 2,250% 18-03/07/2025 | EUR | 6 287 670 | 0,28 | | | | | |
| 10 000 000 | DELL BANK INTERN 1,625% 20-24/06/2024 | EUR | 9 882 910 | 0,43 | | | | | |
| 11 406 000 | FCA BANK IE 0,500% 19-13/09/2024 | EUR | 11 126 375 | 0,49 | | | | | |
| 10 250 000 | HAMMERSON IRLND 1,750% 21-03/06/2027 | EUR | 9 374 327 | 0,41 | | | | | |
| 11 293 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,750% 15-01/02/2025 | EUR | 11 103 708 | 0,49 | | | | | |
| 6 880 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,875% 18-15/01/2026 | EUR | 6 768 579 | 0,30 | | | | | |
| | <i>Japon</i> | | | | | | | <i>57 407 119</i> | <i>2,50</i> |
| 4 275 000 | ASAHI GROUP 0,010% 21-19/04/2024 | EUR | 4 223 816 | 0,18 | | | | | |
| 11 261 000 | MIZUHO FINANCIAL 0,118% 19-06/09/2024 | EUR | 10 975 686 | 0,48 | | | | | |
| 6 000 000 | MIZUHO FINANCIAL 0,184% 21-13/04/2026 | EUR | 5 593 562 | 0,24 | | | | | |
| 20 600 000 | MIZUHO FINANCIAL 0,523% 19-10/06/2024 | EUR | 20 284 136 | 0,89 | | | | | |
| 2 400 000 | NISSAN MOTOR CO 2,652% 20-17/03/2026 | EUR | 2 341 869 | 0,10 | | | | | |
| 5 974 000 | NTT FINANCE 0,010% 21-03/03/2025 | EUR | 5 731 547 | 0,25 | | | | | |
| 8 771 000 | NTT FINANCE 0,082% 21-13/12/2025 | EUR | 8 256 503 | 0,36 | | | | | |
| | <i>Roumanie</i> | | | | | | | <i>56 785 468</i> | <i>2,49</i> |
| 3 486 000 | NE PROPERTY 2,000% 22-20/01/2030 | EUR | 2 788 800 | 0,12 | | | | | |
| 15 175 000 | NE PROPERTY COOP 1,750% 17-23/11/2024 | EUR | 14 661 782 | 0,64 | | | | | |
| 3 000 000 | ROMANIA 2,750% 15-29/10/2025 | EUR | 2 920 800 | 0,13 | | | | | |
| 10 000 000 | ROMANIA 2,750% 20-26/02/2026 | EUR | 9 789 200 | 0,43 | | | | | |
| 15 757 000 | ROMANIA 3,625% 14-24/04/2024 | EUR | 15 728 795 | 0,69 | | | | | |
| 10 643 000 | ROMANIA 5,000% 22-27/09/2026 | EUR | 10 896 091 | 0,48 | | | | | |
| | <i>Suède</i> | | | | | | | <i>52 348 846</i> | <i>2,29</i> |
| 11 500 000 | MOLNLYCKE HLD 1,750% 15-28/02/2024 | EUR | 11 447 845 | 0,50 | | | | | |
| 14 910 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 3,875% 23-10/05/2027 | EUR | 15 210 141 | 0,67 | | | | | |
| 19 768 000 | VOLVO TREAS AB 0,000% 21-09/05/2024 | EUR | 19 479 791 | 0,85 | | | | | |
| 2 755 000 | VOLVO TREAS AB 0,125% 20-17/09/2024 | EUR | 2 681 830 | 0,12 | | | | | |
| 3 516 000 | VOLVO TREAS AB 3,500% 23-17/11/2025 | EUR | 3 529 239 | 0,15 | | | | | |
| | <i>Belgique</i> | | | | | | | <i>41 660 283</i> | <i>1,82</i> |
| 20 600 000 | BELFIUS BANK SA 1,000% 17-26/10/2024 | EUR | 20 104 244 | 0,88 | | | | | |
| 7 700 000 | BELFIUS BANK SA 3,125% 16-11/05/2026 | EUR | 7 582 999 | 0,33 | | | | | |
| 14 000 000 | KBC GROUP NV 1,125% 19-25/01/2024 | EUR | 13 973 040 | 0,61 | | | | | |
| | <i>Danemark</i> | | | | | | | <i>32 726 974</i> | <i>1,43</i> |
| 22 900 000 | NYKREDIT 0,125% 19-10/07/2024 | EUR | 22 440 117 | 0,98 | | | | | |
| 10 300 000 | NYKREDIT 0,875% 19-17/01/2024 | EUR | 10 286 857 | 0,45 | | | | | |
| | <i>Finlande</i> | | | | | | | <i>22 132 494</i> | <i>0,97</i> |
| 6 151 000 | OP CORPORATE BK 0,100% 20-16/11/2027 | EUR | 5 474 534 | 0,24 | | | | | |
| 8 000 000 | OP CORPORATE BK 1,000% 18-22/05/2025 | EUR | 7 730 978 | 0,34 | | | | | |
| 8 833 000 | STORA ENSO OYJ 4,000% 23-01/06/2026 | EUR | 8 926 982 | 0,39 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Enhanced Bond 6M

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Australie</i> | | 17 068 092 | 0,75 | | | | | |
| 9 287 000 | AUST & NZ BANK 3,437% 23-04/04/2025 | EUR | 9 293 874 | 0,41 | 5 000 000 | GOLDMAN SACHS GROUP 21-30/04/2024 FRN | EUR | 5 000 917 | 0,22 |
| 8 060 000 | TOYOTA FIN AUSTR 0,064% 22-13/01/2025 | EUR | 7 774 218 | 0,34 | 8 576 000 | MORGAN STANLEY 17-23/10/2026 FRN | EUR | 8 226 521 | 0,36 |
| | <i>Portugal</i> | | 14 532 674 | 0,64 | 1 900 000 | MORGAN STANLEY 22-08/05/2026 FRN | EUR | 1 856 424 | 0,08 |
| 5 800 000 | BANCO SANTANDER TOTTA 0,875% 17-25/04/2024 | EUR | 5 741 763 | 0,25 | | <i>Espagne</i> | | 46 429 070 | 2,04 |
| 2 300 000 | BRISA CONCESSAO 1,875% 15-30/04/2025 | EUR | 2 250 297 | 0,10 | 10 800 000 | BANCO SABADELL 22-08/09/2026 FRN | EUR | 11 005 717 | 0,48 |
| 6 700 000 | CAIXA GERAL DEPO 1,250% 19-25/11/2024 | EUR | 6 540 614 | 0,29 | 4 100 000 | BANCO SABADELL 23-08/09/2029 FRN | EUR | 4 261 074 | 0,19 |
| | <i>Corée du Sud</i> | | 14 516 534 | 0,64 | 4 000 000 | BANCO SANTANDER 17-11/05/2024 FRN | EUR | 4 010 330 | 0,18 |
| 15 700 000 | KHFC 0,010% 21-29/06/2026 | EUR | 14 516 534 | 0,64 | 9 000 000 | BANCO SANTANDER 22-26/01/2025 FRN | EUR | 8 973 316 | 0,39 |
| | <i>Norvège</i> | | 13 141 384 | 0,58 | 12 500 000 | BANCO SANTANDER 23-16/01/2025 FRN | EUR | 12 532 447 | 0,55 |
| 12 487 000 | SPAREBANK 1 SR 4,875% 23-24/08/2028 | EUR | 13 141 384 | 0,58 | 6 000 000 | CAIXABANK 20-18/11/2026 FRN | EUR | 5 646 186 | 0,25 |
| | <i>Mexique</i> | | 9 746 198 | 0,43 | | <i>Pays-Bas</i> | | 32 612 946 | 1,43 |
| 9 800 000 | AMERICA MOVIL SA 1,500% 16-10/03/2024 | EUR | 9 746 198 | 0,43 | 19 200 000 | COOPERATIEVE RAB 23-03/11/2026 FRN | EUR | 19 313 831 | 0,85 |
| | <i>Pologne</i> | | 9 634 300 | 0,42 | 8 500 000 | ING GROEP NV 17-15/02/2029 FRN | EUR | 8 472 406 | 0,37 |
| 10 000 000 | REPUBLIC OF POLAND 0,000% 20-10/02/2025 | EUR | 9 634 300 | 0,42 | 5 000 000 | ING GROEP NV 21-29/11/2025 FRN | EUR | 4 826 709 | 0,21 |
| | <i>Canada</i> | | 2 923 667 | 0,13 | | <i>Canada</i> | | 25 316 999 | 1,11 |
| 2 960 000 | ROYAL BANK OF CANADA 0,250% 19-02/05/2024 | EUR | 2 923 667 | 0,13 | 14 147 000 | ROYAL BANK OF CANADA 23-17/01/2025 FRN | EUR | 14 169 681 | 0,62 |
| | Obligations convertibles | | 1 492 140 | 0,07 | 11 125 000 | TORONTO DOMINION BANK 23-21/07/2025 FRN | EUR | 11 147 318 | 0,49 |
| | <i>Allemagne</i> | | 1 492 140 | 0,07 | | <i>Irlande</i> | | 23 206 813 | 1,02 |
| 1 500 000 | FRESENIUS SE & CO 0,000% 17-31/01/2024 CV | EUR | 1 492 140 | 0,07 | 11 000 000 | AIB GROUP PLC 19-19/11/2029 FRN | EUR | 10 685 952 | 0,47 |
| | Obligations à taux flottant | | 483 312 545 | 21,17 | 12 800 000 | BANK OF IRELAND 19-14/10/2029 FRN | EUR | 12 520 861 | 0,55 |
| | <i>Italie</i> | | 130 298 199 | 5,70 | | <i>Danemark</i> | | 11 468 492 | 0,50 |
| 19 685 000 | CREDITO EMILIANO 19-25/10/2025 FRN | EUR | 19 201 302 | 0,84 | 11 800 000 | JYSKE BANK A/S 20-15/10/2025 FRN | EUR | 11 468 492 | 0,50 |
| 56 000 000 | ITALY CCTS EU 22-15/10/2030 FRN | EUR | 55 119 493 | 2,41 | | <i>Japon</i> | | 9 228 600 | 0,41 |
| 40 000 000 | ITALY CCTS EU 23-15/10/2028 FRN | EUR | 40 124 879 | 1,76 | 4 300 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCE 22-14/06/2025 FRN | EUR | 4 261 475 | 0,19 |
| 4 422 000 | MEDIOBANCA SPA 23-13/09/2027 FRN | EUR | 4 545 606 | 0,20 | 5 000 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCE 22-19/09/2025 FRN | EUR | 4 967 125 | 0,22 |
| 7 740 000 | UNICREDIT SPA 19-23/09/2029 FRN | EUR | 7 544 791 | 0,33 | | <i>Autriche</i> | | 7 566 932 | 0,33 |
| 3 900 000 | UNICREDIT SPA 20-16/06/2026 FRN | EUR | 3 762 128 | 0,16 | 7 500 000 | RAIFFEISEN BK IN 23-26/01/2027 FRN | EUR | 7 566 932 | 0,33 |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | 69 526 376 | 3,04 | | <i>Norvège</i> | | 6 813 811 | 0,30 |
| 4 900 000 | AVIVA PLC 14-03/07/2044 FRN | EUR | 4 855 968 | 0,21 | 7 000 000 | DNB BANK ASA 22-31/05/2026 FRN | EUR | 6 813 811 | 0,30 |
| 14 300 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 20-01/04/2026 FRN | EUR | 14 252 234 | 0,62 | | <i>Suède</i> | | 5 764 176 | 0,25 |
| 9 483 000 | NATWEST MARKETS 23-13/01/2026 FRN | EUR | 9 553 915 | 0,42 | 5 782 000 | NORDEA BANK AB 23-10/02/2026 FRN | EUR | 5 764 176 | 0,25 |
| 10 800 000 | ROYAL BANK OF SCOTLAND 18-02/03/2026 FRN | EUR | 10 513 850 | 0,46 | | <i>Belgique</i> | | 2 241 156 | 0,10 |
| 20 000 000 | ROYAL BANK OF SCOTLAND 18-04/03/2025 FRN | EUR | 19 913 018 | 0,87 | 2 300 000 | KBC GROUP NV 17-18/09/2029 FRN | EUR | 2 241 156 | 0,10 |
| 10 500 000 | SANTANDER UK GRP 20-28/02/2025 FRN | EUR | 10 437 391 | 0,46 | | Instruments du marché monétaire | | 12 874 940 | 0,56 |
| | <i>France</i> | | 57 712 247 | 2,53 | | <i>Luxembourg</i> | | 12 874 940 | 0,56 |
| 5 400 000 | ALD SA 23-21/02/2025 FRN | EUR | 5 405 731 | 0,24 | 13 000 000 | EU BILL 0,000% 23-05/04/2024 | EUR | 12 874 940 | 0,56 |
| 19 600 000 | BNP PARIBAS 19-15/07/2025 FRN | EUR | 19 228 742 | 0,84 | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 102 577 585 | 4,49 |
| 4 900 000 | CREDIT AGRICOLE SA 20-22/04/2026 FRN | EUR | 4 725 409 | 0,21 | | <i>France</i> | | 77 682 003 | 3,40 |
| 5 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA 23-28/08/2033 FRN | EUR | 5 349 608 | 0,23 | 3 274,00 | BNP PARIBAS MONEY 3M - IC | EUR | 77 682 003 | 3,40 |
| 8 700 000 | CREDIT LOGEMENT 17-28/11/2029 FRN | EUR | 8 394 139 | 0,37 | | <i>Luxembourg</i> | | 24 895 582 | 1,09 |
| 15 300 000 | LA BANQUE POSTALE 20-17/06/2026 FRN | EUR | 14 608 618 | 0,64 | 141 266,99 | BNP PARIBAS FUNDS EURO FLEXIBLE BOND - I CAP | EUR | 15 049 172 | 0,66 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 55 126 728 | 2,41 | 90,00 | BNP PARIBAS FUNDS GLOBAL ENHANCED BOND 36M - X CAP | EUR | 9 846 410 | 0,43 |
| 16 000 000 | BANK OF AMERICA CORP 17-07/02/2025 FRN | EUR | 15 958 267 | 0,70 | | Total portefeuille-titres | | 2 241 842 053 | 98,11 |
| 15 000 000 | BANK OF AMERICA CORP 21-24/08/2025 FRN | EUR | 15 062 459 | 0,66 | | | | | |
| 9 000 000 | GOLDMAN SACHS GP 21-23/09/2027 FRN | EUR | 9 022 140 | 0,39 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH)

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 21 331 053 | 85,13 |
| Actions | | | 21 331 053 | 85,13 |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | <i>11 928 285</i> | <i>47,61</i> |
| 10 155 | ALBEMARLE CORP | USD | 1 467 194 | 5,86 |
| 106 180 | ARRAY TECHNOLOGIES INC | USD | 1 783 823 | 7,12 |
| 80 270 | FLUENCE ENERGY INC | USD | 1 914 439 | 7,64 |
| 66 769 | LIVENT CORP | USD | 1 200 507 | 4,79 |
| 115 132 | PLUG POWER INC | USD | 518 094 | 2,07 |
| 70 351 | SHOALS TECHNOLOGIES GROUP - A | USD | 1 093 255 | 4,36 |
| 162 955 | SUNNOVA ENERGY INTERNATIONAL | USD | 2 485 063 | 9,92 |
| 74 677 | SUNRUN INC | USD | 1 465 910 | 5,85 |
| <i>Allemagne</i> | | | <i>2 290 616</i> | <i>9,14</i> |
| 89 776 | SIEMENS ENERGY AG | EUR | 1 190 053 | 4,75 |
| 54 000 | THYSSENKRUPP NUCERA AG & CO | EUR | 1 100 563 | 4,39 |
| <i>Chine</i> | | | <i>2 032 832</i> | <i>8,11</i> |
| 37 500 | BYD CO LTD-H | HKD | 1 029 636 | 4,11 |
| 43 580 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGICAL A | CNY | 1 003 196 | 4,00 |
| <i>Inde</i> | | | <i>1 219 932</i> | <i>4,87</i> |
| 159 260 | RENEW ENERGY GLOBAL PLC-A | USD | 1 219 932 | 4,87 |
| <i>Espagne</i> | | | <i>1 153 740</i> | <i>4,60</i> |
| 56 380 | EDP RENOVAVEIS SA | EUR | 1 153 740 | 4,60 |
| <i>Suède</i> | | | <i>1 090 667</i> | <i>4,35</i> |
| 924 294 | OATLY GROUP AB | USD | 1 090 667 | 4,35 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | <i>839 333</i> | <i>3,35</i> |
| 360 186 | CERES POWER HOLDINGS PLC | GBP | 839 333 | 3,35 |
| <i>Suisse</i> | | | <i>775 648</i> | <i>3,10</i> |
| 3 339 150 | MEYER BURGER TECHNOLOGY AG | CHF | 775 648 | 3,10 |
| Total portefeuille-titres | | | 21 331 053 | 85,13 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 367 671 767 | 85,44 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | <i>Espagne</i> | | | | |
| 1 268 000 | AIRBUS SE 1,375% 20-09/06/2026 | EUR | 1 219 671 | 0,28 | 1 400 000 | ADIF ALTA VELOCI 0,550% 21-31/10/2031 | EUR | 1 140 538 | 0,27 |
| 2 000 000 | AXA HOME LOAN 0,050% 19-05/07/2027 | EUR | 1 819 316 | 0,42 | 1 700 000 | BANCO SANTANDER 1,125% 20-23/06/2027 | EUR | 1 585 129 | 0,37 |
| 1 455 000 | AXA SA 3,625% 23-10/01/2033 | EUR | 1 537 789 | 0,36 | 2 000 000 | BANKINTER SA 3,050% 22-29/05/2028 | EUR | 2 007 803 | 0,47 |
| 1 400 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,100% 20-08/10/2027 | EUR | 1 252 969 | 0,29 | 1 800 000 | CAJA RURAL NAV 0,875% 18-08/05/2025 | EUR | 1 740 678 | 0,40 |
| 400 000 | BOUYGUES SA 3,875% 23-17/07/2031 | EUR | 416 867 | 0,10 | 2 000 000 | CAJA RURAL NAV 3,000% 23-26/04/2027 | EUR | 2 002 108 | 0,47 |
| 1 400 000 | BPCE 0,250% 20-15/01/2026 | EUR | 1 315 430 | 0,31 | 1 400 000 | CELLNEX FINANCE 1,000% 21-15/09/2027 | EUR | 1 280 717 | 0,30 |
| 1 100 000 | BPCE 4,000% 22-29/11/2032 | EUR | 1 148 229 | 0,27 | 700 000 | IBERDROLA FIN SA 1,375% 22-11/03/2032 | EUR | 620 348 | 0,14 |
| 2 100 000 | BPCE SFH 0,010% 20-23/03/2028 | EUR | 1 871 296 | 0,43 | 1 000 000 | IBERDROLA FIN SA 3,625% 23-13/07/2033 | EUR | 1 035 276 | 0,24 |
| 2 500 000 | BPCE SFH 0,625% 19-22/09/2027 | EUR | 2 316 045 | 0,54 | 4 950 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,100% 21-30/04/2031 | EUR | 4 090 272 | 0,95 |
| 1 800 000 | BPCE SFH 1,750% 22-27/05/2032 | EUR | 1 650 200 | 0,38 | 4 300 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,700% 22-30/04/2032 | EUR | 3 626 698 | 0,84 |
| 800 000 | BPCE SFH 3,375% 23-27/06/2033 | EUR | 830 210 | 0,19 | 4 000 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,850% 21-30/07/2037 | EUR | 2 956 160 | 0,69 |
| 1 000 000 | BPIFRANCE 3,375% 22-25/11/2032 | EUR | 1 047 751 | 0,24 | 1 123 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,000% 21-30/07/2042 | EUR | 754 038 | 0,18 |
| 1 700 000 | CAISSE FR DE FINANCEMENT 0,010% 20-07/05/2025 | EUR | 1 628 255 | 0,38 | 5 200 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,200% 20-31/10/2040 | EUR | 3 744 884 | 0,87 |
| 2 600 000 | CAISSE FR DE FINANCEMENT 0,500% 19-19/02/2027 | EUR | 2 424 472 | 0,56 | 3 000 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,400% 18-30/04/2028 | EUR | 2 864 340 | 0,67 |
| 4 000 000 | CAISSE FR DE FINANCEMENT 1,125% 22-12/06/2028 | EUR | 3 728 661 | 0,87 | 2 000 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,900% 22-31/10/2052 | EUR | 1 388 780 | 0,32 |
| 1 600 000 | CAPGEMINI SE 1,625% 20-15/04/2026 | EUR | 1 548 338 | 0,36 | 4 100 000 | SPANISH GOVERNMENT 2,750% 14-31/10/2024 | EUR | 4 080 976 | 0,95 |
| 1 500 000 | CIE FIN FONCIER 3,125% 22-18/05/2027 | EUR | 1 514 003 | 0,35 | 1 400 000 | SPANISH GOVERNMENT 2,900% 16-31/10/2046 | EUR | 1 270 640 | 0,30 |
| 3 000 000 | CNP ASSURANCES 0,375% 20-08/03/2028 | EUR | 2 637 070 | 0,61 | 5 000 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,150% 23-30/04/2033 | EUR | 5 076 149 | 1,18 |
| 400 000 | COVIVIO 4,625% 23-05/06/2032 | EUR | 414 693 | 0,10 | 1 600 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,450% 16-30/07/2066 | EUR | 1 493 594 | 0,35 |
| 900 000 | CREDIT AGRICOLE HOME L 1,625% 22-31/05/2030 | EUR | 837 412 | 0,19 | <i>Allemagne</i> | | | | |
| 1 100 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 1,625% 19-15/04/2026 | EUR | 1 057 259 | 0,25 | 900 000 | BERLIN HYP AG 3,000% 23-10/01/2033 | EUR | 920 969 | 0,21 |
| 3 000 000 | DEXIA CREDIT LOCAL 0,000% 19-29/05/2024 | EUR | 2 953 230 | 0,69 | 7 300 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0,000% 16-15/08/2026 | EUR | 6 910 618 | 1,61 |
| 3 500 000 | DEXIA CREDIT LOCAL 0,010% 20-22/01/2027 | EUR | 3 235 881 | 0,75 | 8 670 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0,000% 20-15/08/2030 | EUR | 7 671 650 | 1,77 |
| 1 000 000 | ELEC DE FRANCE 1,000% 16-13/10/2026 | EUR | 946 206 | 0,22 | 1 750 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0,000% 21-15/05/2036 | EUR | 1 344 018 | 0,31 |
| 4 300 000 | FRANCE O.A.T. 0,000% 19-25/11/2029 | EUR | 3 774 282 | 0,88 | 5 200 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 1,000% 22-15/05/2038 | EUR | 4 427 072 | 1,03 |
| 750 000 | FRANCE O.A.T. 0,000% 20-25/11/2030 | EUR | 641 138 | 0,15 | 2 500 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 120 1,300% 22-15/10/2027 | EUR | 2 447 175 | 0,57 |
| 2 670 000 | FRANCE O.A.T. 0,500% 21-25/06/2044 | EUR | 1 678 442 | 0,39 | 1 600 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 3,250% 10-04/07/2042 | EUR | 1 829 936 | 0,43 |
| 2 800 000 | FRANCE O.A.T. 0,750% 21-25/05/2053 | EUR | 1 578 304 | 0,37 | 3 913 000 | DZ HYP AG 0,010% 21-29/03/2030 | EUR | 3 323 942 | 0,77 |
| 1 200 000 | FRANCE O.A.T. 1,250% 16-25/05/2036 | EUR | 1 017 660 | 0,24 | 3 900 000 | KFW 1,125% 18-09/05/2033 | EUR | 3 444 987 | 0,80 |
| 3 000 000 | FRANCE O.A.T. 1,250% 18-25/05/2034 | EUR | 2 641 500 | 0,61 | 2 000 000 | SAP SE 0,125% 20-18/05/2026 | EUR | 1 879 893 | 0,44 |
| 2 200 000 | FRANCE O.A.T. 1,250% 22-25/05/2038 | EUR | 1 795 860 | 0,42 | 664 000 | UNICREDIT 0,010% 21-28/09/2026 | EUR | 616 312 | 0,14 |
| 10 000 000 | FRANCE O.A.T. 1,750% 17-25/06/2039 | EUR | 8 714 199 | 2,01 | 1 600 000 | VONOVIA SE 0,000% 21-01/12/2025 | EUR | 1 491 383 | 0,35 |
| 3 000 000 | FRANCE O.A.T. 2,000% 22-25/11/2032 | EUR | 2 893 020 | 0,67 | 600 000 | VONOVIA SE 5,000% 22-23/11/2030 | EUR | 633 201 | 0,15 |
| 8 200 000 | FRANCE O.A.T. 3,000% 23-25/05/2033 | EUR | 8 545 465 | 1,98 | <i>Italie</i> | | | | |
| 3 300 000 | FRANCE O.A.T. 3,000% 23-25/05/2054 | EUR | 3 235 632 | 0,75 | 550 000 | ASSICURAZIONI 2,429% 20-14/07/2031 | EUR | 478 162 | 0,11 |
| 600 000 | KERING 0,750% 20-13/05/2028 | EUR | 549 331 | 0,13 | 905 000 | BANCO BPM SPA 3,875% 23-18/09/2026 | EUR | 921 318 | 0,21 |
| 1 100 000 | KERING 3,625% 23-05/09/2031 | EUR | 1 136 637 | 0,26 | 2 300 000 | CREDIT AGRICOLE 1,000% 19-25/03/2027 | EUR | 2 159 612 | 0,50 |
| 2 700 000 | LA BANQUE POSTALE 3,000% 23-31/01/2031 | EUR | 2 739 820 | 0,64 | 1 819 000 | INTESA SANPAOLO 0,750% 21-16/03/2028 | EUR | 1 635 610 | 0,38 |
| 600 000 | LA POSTE SA 0,375% 19-17/09/2027 | EUR | 545 835 | 0,13 | 1 327 000 | INTESA SANPAOLO 3,625% 23-30/06/2028 | EUR | 1 360 768 | 0,32 |
| 1 700 000 | LA POSTE SA 1,375% 20-21/04/2032 | EUR | 1 472 888 | 0,34 | 1 300 000 | INTESA SANPAOLO 5,250% 22-13/01/2030 | EUR | 1 392 062 | 0,32 |
| 1 500 000 | LVMH MOET HENNESSY 0,750% 20-07/04/2025 | EUR | 1 453 824 | 0,34 | 8 168 000 | ITALY BTIPS 0,450% 21-15/02/2029 | EUR | 7 167 502 | 1,67 |
| 2 100 000 | MICHELIN 0,000% 20-02/11/2028 | EUR | 1 850 387 | 0,43 | 1 300 000 | ITALY BTIPS 2,100% 19-15/07/2026 | EUR | 1 277 991 | 0,30 |
| 1 200 000 | PERNOD RICARD SA 1,375% 22-07/04/2029 | EUR | 1 110 598 | 0,26 | 5 200 000 | ITALY BTIPS 2,950% 18-01/09/2038 | EUR | 4 606 264 | 1,07 |
| 600 000 | PERNOD RICARD SA 3,750% 22-02/11/2032 | EUR | 628 074 | 0,15 | 5 000 000 | ITALY BTIPS 4,000% 23-15/11/2030 | EUR | 5 204 200 | 1,21 |
| 3 031 000 | RCI BANQUE 1,125% 20-15/01/2027 | EUR | 2 834 855 | 0,66 | 3 100 000 | ITALY BTIPS 4,500% 23-01/10/2053 | EUR | 3 191 404 | 0,74 |
| 680 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-14/06/2028 | EUR | 714 724 | 0,17 | 320 000 | TERNA RETE 3,875% 23-24/07/2033 | EUR | 329 702 | 0,08 |
| 600 000 | SCHNEIDER ELEC 1,000% 20-09/04/2027 | EUR | 568 026 | 0,13 | 2 000 000 | TERNA SPA 0,750% 20-24/07/2032 | EUR | 1 629 834 | 0,38 |
| 1 400 000 | SUEZ 5,000% 22-03/11/2032 | EUR | 1 550 318 | 0,36 | | | | | |

Les notes en annexe font partie intégrante de ces états financiers.

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Pays-Bas | | 29 269 454 | 6,80 | | | | | |
| 1 900 000 | ABN AMRO BANK NV 2,375% 22-01/06/2027 | EUR | 1 848 487 | 0,43 | 3 500 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,900% 22-20/02/2032 | EUR | 3 070 589 | 0,71 |
| 812 000 | AKZO NOBEL NV 1,500% 22-28/03/2028 | EUR | 762 069 | 0,18 | 2 000 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 1,200% 15-20/10/2025 | EUR | 1 952 598 | 0,45 |
| 1 542 000 | BNG BANK NV 0,125% 21-19/04/2033 | EUR | 1 218 397 | 0,28 | 2 700 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 2,900% 23-20/02/2033 | EUR | 2 763 410 | 0,64 |
| 2 600 000 | EDP FINANCE BV 0,375% 19-16/09/2026 | EUR | 2 420 228 | 0,56 | | Canada | | 12 178 993 | 2,83 |
| 4 000 000 | FIAT CHRYSLER AU 3,875% 20-05/01/2026 | EUR | 4 031 913 | 0,94 | 2 900 000 | BANK NOVA SCOTIA 0,010% 21-14/09/2029 | EUR | 2 459 462 | 0,57 |
| 3 000 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 0,000% 21-15/01/2029 | EUR | 2 696 355 | 0,63 | 3 312 000 | CAN IMPERIAL BK 0,375% 22-10/03/2026 | EUR | 3 125 563 | 0,73 |
| 1 800 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 0,500% 19-15/01/2040 | EUR | 1 334 610 | 0,31 | 2 645 000 | ROYAL BANK OF CANADA 2,375% 22-13/09/2027 | EUR | 2 598 053 | 0,60 |
| 2 500 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 0,500% 22-15/07/2032 | EUR | 2 158 725 | 0,50 | 2 282 000 | TORONTO DOMINION BANK 0,864% 22-24/03/2027 | EUR | 2 138 096 | 0,50 |
| 3 000 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 3,750% 10-15/01/2042 | EUR | 3 539 880 | 0,82 | 1 838 000 | TORONTO DOMINION BANK 3,631% 22-13/12/2029 | EUR | 1 857 819 | 0,43 |
| 2 100 000 | SIEMENS FINAN 3,375% 23-24/08/2031 | EUR | 2 165 701 | 0,50 | | Irlande | | 10 903 743 | 2,54 |
| 1 483 000 | STELLANTIS NV 0,625% 21-30/03/2027 | EUR | 1 365 421 | 0,32 | 8 800 000 | IRISH GOVERNMENT 0,400% 20-15/05/2035 | EUR | 7 007 264 | 1,63 |
| 648 000 | STELLANTIS NV 4,375% 23-14/03/2030 | EUR | 683 557 | 0,16 | 915 385 | IRISH GOVERNMENT 3,000% 23-18/10/2043 | EUR | 945 064 | 0,22 |
| 420 000 | SWISSCOM FIN 0,375% 20-14/11/2028 | EUR | 374 323 | 0,09 | 3 000 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,875% 18-15/01/2026 | EUR | 2 951 415 | 0,69 |
| 2 973 000 | TENNET HLD BV 1,625% 22-17/11/2026 | EUR | 2 899 749 | 0,67 | | Finlande | | 7 411 730 | 1,72 |
| 1 340 000 | TOYOTA MOTOR FIN 3,500% 23-13/01/2028 | EUR | 1 364 646 | 0,32 | 7 000 000 | FINNISH GOVERNMENT 0,000% 20-15/09/2030 | EUR | 5 973 034 | 1,39 |
| 400 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,750% 22-28/09/2027 | EUR | 405 393 | 0,09 | 1 404 000 | STORA ENSO OYJ 4,250% 23-01/09/2029 | EUR | 1 438 696 | 0,33 |
| | Belgique | | 29 124 369 | 6,76 | | Suède | | 7 019 502 | 1,64 |
| 2 600 000 | BELFIUS BANK SA 0,750% 15-10/02/2025 | EUR | 2 525 323 | 0,59 | 2 030 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 0,375% 19-09/02/2026 | EUR | 1 924 344 | 0,45 |
| 2 500 000 | BELGIUM GOVERNMENT 1,250% 18-22/04/2033 | EUR | 2 234 538 | 0,52 | 1 690 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 0,750% 22-09/08/2027 | EUR | 1 536 129 | 0,36 |
| 6 200 000 | BELGIUM GOVERNMENT 1,600% 16-22/06/2047 | EUR | 4 659 378 | 1,08 | 1 356 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 0,010% 20-02/12/2027 | EUR | 1 198 403 | 0,28 |
| 1 400 000 | BELGIUM GOVERNMENT 1,700% 19-22/06/2050 | EUR | 1 042 328 | 0,24 | 721 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 2,625% 22-05/09/2029 | EUR | 703 387 | 0,16 |
| 2 600 000 | BELGIUM GOVERNMENT 1,900% 15-22/06/2038 | EUR | 2 290 022 | 0,53 | 1 700 000 | VOLVO TREAS AB 1,625% 20-26/05/2025 | EUR | 1 657 239 | 0,39 |
| 1 800 000 | BELGIUM GOVERNMENT 2,750% 22-22/04/2039 | EUR | 1 755 306 | 0,41 | | Royaume-Uni | | 5 538 917 | 1,29 |
| 980 000 | BELGIUM GOVERNMENT 3,000% 14-22/06/2034 | EUR | 1 008 081 | 0,23 | 870 000 | DS SMITH PLC 0,875% 19-12/09/2026 | EUR | 811 833 | 0,19 |
| 5 000 000 | BELGIUM GOVERNMENT 3,000% 23-22/06/2033 | EUR | 5 161 233 | 1,20 | 922 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 948 377 | 0,22 |
| 600 000 | BNP PARIBAS FORTIS SA 0,625% 18-04/10/2025 | EUR | 575 220 | 0,13 | 4 000 000 | SANTANDER UK PLC 1,125% 22-12/03/2027 | EUR | 3 778 707 | 0,88 |
| 1 260 202 | EUROPEAN UNION 0,000% 21-04/10/2028 | EUR | 1 124 793 | 0,26 | | Etats-Unis d'Amérique | | 4 204 736 | 0,97 |
| 661 000 | EUROPEAN UNION 0,300% 20-04/11/2050 | EUR | 338 755 | 0,08 | 1 502 000 | JOHNSON CONTROLS 0,375% 20-15/09/2027 | EUR | 1 355 149 | 0,31 |
| 5 200 000 | EUROPEAN UNION 0,800% 22-04/07/2025 | EUR | 5 044 110 | 1,17 | 3 055 000 | TOYOTA MTR CREDIT 0,250% 20-16/07/2026 | EUR | 2 849 587 | 0,66 |
| 1 349 080 | EUROPEAN UNION 2,750% 22-04/02/2033 | EUR | 1 365 282 | 0,32 | | Portugal | | 3 311 782 | 0,77 |
| | Luxembourg | | 25 812 962 | 6,00 | 1 700 000 | BANCO SANTANDER TOTTA 1,250% 17-26/09/2027 | EUR | 1 608 517 | 0,37 |
| 5 726 000 | EIB 0,375% 16-14/04/2026 | EUR | 5 467 156 | 1,27 | 1 500 000 | PORTUGUESE OTS 4,100% 15-15/02/2045 | EUR | 1 703 265 | 0,40 |
| 5 000 000 | EIB 1,125% 17-13/04/2033 | EUR | 4 399 181 | 1,02 | | Japon | | 3 029 522 | 0,71 |
| 1 474 000 | EIB 2,750% 23-28/07/2028 | EUR | 1 498 719 | 0,35 | 1 633 000 | ASAHI GROUP 0,336% 21-19/04/2027 | EUR | 1 486 565 | 0,35 |
| 5 000 000 | ESM 0,500% 19-05/03/2029 | EUR | 4 534 796 | 1,05 | 682 000 | ASAHI GROUP 0,541% 20-23/10/2028 | EUR | 601 616 | 0,14 |
| 3 400 000 | LUXEMBOURG GOVERNMENT 0,000% 19-13/11/2026 | EUR | 3 177 861 | 0,74 | 1 000 000 | NTT FINANCE 0,082% 21-13/12/2025 | EUR | 941 341 | 0,22 |
| 1 015 000 | LUXEMBOURG GOVERNMENT 0,000% 20-28/04/2025 | EUR | 976 242 | 0,23 | | Norvège | | 1 595 446 | 0,37 |
| 2 200 000 | NESTLE FINANCE INTERNATIONAL 0,125% 20-12/11/2027 | EUR | 2 005 177 | 0,47 | 1 516 000 | SPAREBANK 1 SR 4,875% 23-24/08/2028 | EUR | 1 595 446 | 0,37 |
| 4 247 000 | NOVARTIS FINANCE 0,000% 20-23/09/2028 | EUR | 3 753 830 | 0,87 | | Obligations à taux flottant | | 30 413 640 | 7,07 |
| | Autriche | | 24 193 826 | 5,60 | | France | | 16 951 790 | 3,95 |
| 2 000 000 | OMV AG 0,000% 19-03/07/2025 | EUR | 1 903 588 | 0,44 | 2 600 000 | BNP PARIBAS 20-14/10/2027 FRN | EUR | 2 396 552 | 0,56 |
| 3 700 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,000% 21-20/02/2031 | EUR | 3 103 170 | 0,72 | 1 900 000 | BNP PARIBAS 21-30/05/2028 FRN | EUR | 1 719 142 | 0,40 |
| 4 000 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,000% 22-20/10/2028 | EUR | 3 575 840 | 0,83 | 2 100 000 | BNP PARIBAS 21-31/08/2033 FRN | EUR | 1 800 131 | 0,42 |
| 5 500 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,500% 19-20/02/2029 | EUR | 5 008 633 | 1,16 | 3 000 000 | BPCE 22-14/01/2028 FRN | EUR | 2 736 818 | 0,64 |
| 3 000 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,750% 18-20/02/2028 | EUR | 2 815 998 | 0,65 | 2 000 000 | LA BANQUE POSTALE 20-17/06/2026 FRN | EUR | 1 909 623 | 0,44 |
| | | | | | 1 300 000 | LA BANQUE POSTALE 22-05/03/2034 FRN | EUR | 1 359 909 | 0,32 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 1 800 000 | LA POSTE 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 724 490 | 0,40 |
| 688 000 | TOTAL SA 19-31/12/2049 FRN | EUR | 680 389 | 0,16 |
| 3 200 000 | UNIBAIL-RODAMCO 18-31/12/2049 FRN | EUR | 2 624 736 | 0,61 |
| | <i>Espagne</i> | | <i>4 982 648</i> | <i>1,15</i> |
| 2 300 000 | BANCO SANTANDER 21-24/06/2029 FRN | EUR | 2 034 602 | 0,47 |
| 3 000 000 | MAPFRE 17-31/03/2047 FRN | EUR | 2 948 046 | 0,68 |
| | <i>Italie</i> | | <i>3 422 855</i> | <i>0,79</i> |
| 715 000 | MEDIOBANCA SPA 23-13/09/2027 FRN | EUR | 734 986 | 0,17 |
| 2 724 000 | UNICREDIT SPA 19-03/07/2025 FRN | EUR | 2 687 869 | 0,62 |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>2 143 732</i> | <i>0,50</i> |
| 2 300 000 | ENERGIE BADEN-WU 20-29/06/2080 FRN | EUR | 2 143 732 | 0,50 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>1 599 242</i> | <i>0,37</i> |
| 1 700 000 | OMV AG 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 599 242 | 0,37 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>1 313 373</i> | <i>0,31</i> |
| 1 300 000 | KBC GROUP NV 23-06/06/2026 FRN | EUR | 1 313 373 | 0,31 |
| Autres valeurs mobilières | | | 4 838 050 | 1,12 |
| Obligations | | | 4 838 050 | 1,12 |
| | <i>France</i> | | <i>4 838 050</i> | <i>1,12</i> |
| 5 000 000 | FRANCE O.A.T. 21 25 0,000% 25/02/2025 | EUR | 4 838 050 | 1,12 |
| Instruments du marché monétaire | | | 15 855 564 | 3,67 |
| | <i>France</i> | | <i>9 906 499</i> | <i>2,29</i> |
| 10 000 000 | FRENCH BTF 0,000% 23-04/04/2024 | EUR | 9 906 499 | 2,29 |
| | <i>Italie</i> | | <i>5 949 065</i> | <i>1,38</i> |
| 11 500 000 | ITALY BTIPS HYBRD 0,000% 07-01/08/2039 | EUR | 5 949 065 | 1,38 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 6 009 998 | 1,40 |
| | <i>France</i> | | <i>6 009 998</i> | <i>1,40</i> |
| 256,00 | BNP PARIBAS MONEY 3M - ID EUR | EUR | 6 009 998 | 1,40 |
| Total portefeuille-titres | | | 424 789 019 | 98,70 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Obligations | | 142 840 962 | 79,13 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>26 951 602</i> | <i>14,92</i> | | | | | |
| 100 000 | ARKEMA 0,125% 20-14/10/2026 | EUR | 92 402 | 0,05 | 184 000 | AB INBEV SA/NV 1,125% 19-01/07/2027 | EUR | 173 563 | 0,10 |
| 100 000 | ARKEMA 3,500% 23-23/01/2031 | EUR | 100 056 | 0,06 | 793 775 | BELGIUM GOVERNMENT 1,700% 19-22/06/2050 | EUR | 590 981 | 0,33 |
| 100 000 | AXA SA 3,625% 23-10/01/2033 | EUR | 105 690 | 0,06 | 230 000 | BELGIUM GOVERNMENT 1,900% 15-22/06/2038 | EUR | 202 579 | 0,11 |
| 200 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,375% 23-02/05/2030 | EUR | 207 670 | 0,12 | 240 000 | BELGIUM GOVERNMENT 2,250% 17-22/06/2057 | EUR | 197 383 | 0,11 |
| 200 000 | BNP PARIBAS 3,625% 22-01/09/2029 | EUR | 200 570 | 0,11 | 420 000 | BELGIUM GOVERNMENT 4,250% 10-28/03/2041 | EUR | 490 631 | 0,27 |
| 100 000 | BOUYGUES SA 4,625% 22-07/06/2032 | EUR | 109 691 | 0,06 | 700 000 | BELGIUM GOVERNMENT 4,500% 11-28/03/2026 | EUR | 730 879 | 0,40 |
| 100 000 | BPCE 4,375% 23-13/07/2028 | EUR | 103 283 | 0,06 | 3 218 000 | EUROPEAN UNION 0,000% 21-02/06/2028 | EUR | 2 903 961 | 1,60 |
| 2 700 000 | BPCE SFH 0,010% 20-27/05/2030 | EUR | 2 263 008 | 1,25 | 290 000 | EUROPEAN UNION 0,000% 21-04/07/2031 | EUR | 240 122 | 0,13 |
| 200 000 | CAISSE AMORT DET 0,000% 20-25/11/2030 | EUR | 167 906 | 0,09 | 1 530 890 | EUROPEAN UNION 0,000% 21-04/10/2028 | EUR | 1 366 396 | 0,76 |
| 1 000 000 | CAISSE AMORT DET 3,125% 23-01/03/2030 | EUR | 1 033 222 | 0,57 | 3 660 000 | EUROPEAN UNION 0,000% 21-06/07/2026 | EUR | 3 441 305 | 1,90 |
| 500 000 | CAISSE FR DE FINANCEMENT 0,375% 20-13/02/2040 | EUR | 330 295 | 0,18 | 350 000 | EUROPEAN UNION 0,400% 21-04/02/2037 | EUR | 259 111 | 0,14 |
| 100 000 | CARREFOUR SA 1,875% 22-30/10/2026 | EUR | 96 528 | 0,05 | 100 000 | EUROPEAN UNION 0,700% 21-06/07/2051 | EUR | 56 862 | 0,03 |
| 100 000 | CIE DE ST GOBAIN 1,125% 18-23/03/2026 | EUR | 95 724 | 0,05 | 720 000 | EUROPEAN UNION 1,000% 22-06/07/2032 | EUR | 633 577 | 0,35 |
| 200 000 | CREDIT AGRICOLE SA 3,875% 23-20/04/2031 | EUR | 206 688 | 0,11 | 1 190 000 | EUROPEAN UNION 2,000% 22-04/10/2027 | EUR | 1 172 240 | 0,65 |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA 4,125% 23-07/03/2030 | EUR | 104 447 | 0,06 | 190 000 | EUROPEAN UNION 2,625% 22-04/02/2048 | EUR | 176 917 | 0,10 |
| 200 000 | DANONE 3,071% 22-07/09/2032 | EUR | 199 238 | 0,11 | 500 000 | EUROPEAN UNION 3,000% 22-04/03/2053 | EUR | 490 710 | 0,27 |
| 100 000 | DANONE 3,706% 23-13/11/2029 | EUR | 104 184 | 0,06 | 1 000 000 | EUROPEAN UNION 3,250% 23-04/07/2034 | EUR | 1 048 570 | 0,58 |
| 100 000 | EDENRED 3,625% 23-13/06/2031 | EUR | 101 691 | 0,06 | 928 000 | EUROPEAN UNION 3,375% 22-04/11/2042 | EUR | 968 535 | 0,54 |
| 100 000 | ELO SACA 6,000% 23-22/03/2029 | EUR | 101 372 | 0,06 | 1 300 000 | FLEMISH COMMUNIT 0,010% 20-23/06/2027 | EUR | 1 189 826 | 0,66 |
| 200 000 | ENGIE 1,750% 20-27/03/2028 | EUR | 189 641 | 0,11 | 2 300 000 | FLEMISH COMMUNIT 3,000% 22-12/10/2032 | EUR | 2 314 389 | 1,27 |
| 100 000 | ENGIE 3,500% 22-27/09/2029 | EUR | 101 706 | 0,06 | | <i>Espagne</i> | | <i>14 658 299</i> | <i>8,13</i> |
| 100 000 | ENGIE 3,625% 23-11/01/2030 | EUR | 102 619 | 0,06 | 200 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 3,500% 17-10/02/2027 | EUR | 200 024 | 0,11 |
| 100 000 | ENGIE 3,875% 23-06/01/2031 | EUR | 103 389 | 0,06 | 1 300 000 | BANCO SANTANDER 0,100% 20-27/02/2032 | EUR | 1 028 288 | 0,57 |
| 5 270 000 | FRANCE O.A.T. 0,500% 16-25/05/2026 | EUR | 5 046 656 | 2,79 | 200 000 | BANCO SANTANDER 3,875% 23-16/01/2028 | EUR | 204 641 | 0,11 |
| 4 600 000 | FRANCE O.A.T. 0,500% 19-25/05/2029 | EUR | 4 199 523 | 2,32 | 100 000 | BANCO SANTANDER 4,875% 23-18/10/2031 | EUR | 106 448 | 0,06 |
| 1 717 893 | FRANCE O.A.T. 0,500% 21-25/05/2072 | EUR | 724 470 | 0,40 | 100 000 | CAIXABANK 3,750% 22-07/09/2029 | EUR | 102 480 | 0,06 |
| 220 000 | FRANCE O.A.T. 1,250% 22-25/05/2038 | EUR | 179 586 | 0,10 | 100 000 | CAIXABANK 4,375% 23-29/11/2033 | EUR | 104 978 | 0,06 |
| 2 660 000 | FRANCE O.A.T. 1,750% 17-25/06/2039 | EUR | 2 317 977 | 1,27 | 100 000 | EDP SERVICIOS 4,125% 23-04/04/2029 | EUR | 104 031 | 0,06 |
| 890 000 | FRANCE O.A.T. 2,000% 17-25/05/2048 | EUR | 738 575 | 0,41 | 100 000 | IBERDROLA FIN SA 3,375% 22-22/11/2032 | EUR | 101 896 | 0,06 |
| 180 000 | FRANCE O.A.T. 3,000% 23-25/05/2033 | EUR | 187 583 | 0,10 | 100 000 | INMOBILIARIA COL 0,750% 21-22/06/2029 | EUR | 86 382 | 0,05 |
| 732 049 | FRANCE O.A.T. 3,250% 13-25/05/2045 | EUR | 765 928 | 0,42 | 300 000 | MERLIN PROPERTIES 1,375% 21-01/06/2030 | EUR | 253 946 | 0,14 |
| 300 000 | FRANCE O.A.T. 3,500% 23-25/11/2033 | EUR | 324 966 | 0,18 | 200 000 | SANTANDER ISSUAN 2,500% 15-18/03/2025 | EUR | 196 586 | 0,11 |
| 450 000 | FRANCE O.A.T. 4,000% 05-25/04/2055 | EUR | 533 043 | 0,30 | 330 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,500% 20-30/04/2030 | EUR | 289 400 | 0,16 |
| 110 000 | FRANCE O.A.T. 4,500% 09-25/04/2041 | EUR | 134 415 | 0,07 | 2 310 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,600% 19-31/10/2029 | EUR | 2 063 177 | 1,14 |
| 100 000 | HOLDING DINFRA 4,250% 23-18/03/2030 | EUR | 102 720 | 0,06 | 1 471 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,300% 16-31/10/2026 | EUR | 1 422 104 | 0,79 |
| 100 000 | ICADE SANTE SAS 1,375% 20-17/09/2030 | EUR | 82 409 | 0,05 | 2 020 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,400% 18-30/04/2028 | EUR | 1 928 656 | 1,07 |
| 200 000 | LOREAL SA 2,875% 23-19/05/2028 | EUR | 200 910 | 0,11 | 570 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,450% 17-31/10/2027 | EUR | 548 277 | 0,30 |
| 100 000 | LVMH MOET HENNESSY 3,500% 23-07/09/2033 | EUR | 103 233 | 0,06 | 190 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,850% 19-30/07/2035 | EUR | 167 489 | 0,09 |
| 100 000 | ORANGE 1,250% 20-07/07/2027 | EUR | 94 720 | 0,05 | 1 700 000 | SPANISH GOVERNMENT 2,350% 17-30/07/2033 | EUR | 1 620 457 | 0,90 |
| 102 000 | RCI BANQUE 4,125% 22-01/12/2025 | EUR | 102 666 | 0,06 | 539 000 | SPANISH GOVERNMENT 2,700% 18-31/10/2048 | EUR | 465 459 | 0,26 |
| 124 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-13/07/2026 | EUR | 126 691 | 0,07 | 260 000 | SPANISH GOVERNMENT 2,900% 16-31/10/2046 | EUR | 235 976 | 0,13 |
| 100 000 | SCHNEIDER ELEC 3,250% 23-12/06/2028 | EUR | 102 094 | 0,06 | 403 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,450% 16-30/07/2066 | EUR | 376 199 | 0,21 |
| 100 000 | SOCIETE GENERALE 4,125% 23-02/06/2027 | EUR | 102 520 | 0,06 | 710 000 | SPANISH GOVERNMENT 4,200% 05-31/01/2037 | EUR | 787 504 | 0,44 |
| 100 000 | SOCIETE GENERALE 5,625% 23-02/06/2033 | EUR | 106 579 | 0,06 | 200 000 | SPANISH GOVERNMENT 4,700% 09-30/07/2041 | EUR | 234 682 | 0,13 |
| 400 000 | SOCIETE PARIS 1,700% 19-25/05/2050 | EUR | 281 603 | 0,16 | | | | | |
| 100 000 | SUEZ 5,000% 22-03/11/2032 | EUR | 110 737 | 0,06 | | | | | |
| 4 500 000 | UNEDIC 0,250% 20-25/11/2029 | EUR | 3 958 065 | 2,18 | | | | | |
| 100 000 | URW 4,125% 23-11/12/2030 | EUR | 102 913 | 0,06 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| 660 000 | SPANISH GOVERNMENT 4,900% 07-30/07/2040 | EUR | 784 529 | 0,43 | 1 247 000 | ITALY BTPS 2,800% 16-01/03/2067 | EUR | 911 308 | 0,50 |
| 913 000 | SPANISH GOVERNMENT 5,150% 13-31/10/2044 | EUR | 1 139 716 | 0,63 | 310 000 | ITALY BTPS 3,100% 19-01/03/2040 | EUR | 274 429 | 0,15 |
| 100 000 | TELEFONICA EMIS 4,183% 23-21/11/2033 | EUR | 104 974 | 0,06 | 130 000 | ITALY BTPS 3,450% 17-01/03/2048 | EUR | 115 138 | 0,06 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>13 181 869</i> | <i>7,28</i> | 2 270 000 | ITALY BTPS 3,500% 14-01/03/2030 | EUR | 2 309 487 | 1,27 |
| 100 000 | AT&T INC 3,950% 23-30/04/2031 | EUR | 103 663 | 0,06 | 437 000 | ITALY BTPS 4,450% 23-01/09/2043 | EUR | 450 428 | 0,25 |
| 3 512 238 | FN MA5010 5,500% 23-01/05/2053 | USD | 3 192 357 | 1,76 | 2 700 000 | ITALY BTPS 4,750% 13-01/09/2028 | EUR | 2 904 437 | 1,60 |
| 3 255 812 | FN MA5140 6,500% 23-01/09/2053 | USD | 3 020 219 | 1,66 | 907 000 | ITALY BTPS 5,000% 09-01/09/2040 | EUR | 1 002 702 | 0,56 |
| 3 315 616 | FN MA5166 6,000% 23-01/10/2053 | USD | 3 047 622 | 1,68 | 372 907 | ITALY BTPS I/L 0,550% 18-21/05/2026 | EUR | 359 632 | 0,20 |
| 3 290 794 | FN MA5167 6,500% 23-01/10/2053 | USD | 3 052 670 | 1,68 | 200 000 | SNAM 0,750% 20-17/06/2030 | EUR | 169 842 | 0,09 |
| 100 000 | FORD MOTOR CREDIT 5,125% 23-20/02/2029 | EUR | 104 542 | 0,06 | 200 000 | SNAM 3,375% 22-05/12/2026 | EUR | 201 455 | 0,11 |
| 200 000 | IBM CORP 0,950% 17-23/05/2025 | EUR | 193 358 | 0,11 | 100 000 | TERNA SPA 0,375% 21-23/06/2029 | EUR | 86 302 | 0,05 |
| 100 000 | MCDONALDS CORP 3,875% 23-20/02/2031 | EUR | 103 771 | 0,06 | 100 000 | TERNA SPA 1,000% 19-10/04/2026 | EUR | 95 351 | 0,05 |
| 176 000 | PROLOGIS EURO 0,375% 20-06/02/2028 | EUR | 156 864 | 0,09 | | <i>Allemagne</i> | | <i>9 291 613</i> | <i>5,15</i> |
| 100 000 | UNILEVER CAPITAL 3,400% 23-06/06/2033 | EUR | 102 864 | 0,06 | 170 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 2,500% 12-04/07/2044 | EUR | 175 933 | 0,10 |
| 100 000 | VERALTO CORP 4,150% 23-19/09/2031 | EUR | 103 939 | 0,06 | 1 340 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 4,750% 08-04/07/2040 | EUR | 1 795 520 | 0,99 |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>11 138 188</i> | <i>6,22</i> | 100 000 | EUROGRID GMBH 3,279% 22-05/09/2031 | EUR | 99 388 | 0,06 |
| 100 000 | ABN AMRO BANK NV 5,500% 23-21/09/2033 | EUR | 104 602 | 0,06 | 100 000 | INFINEON TECH 1,125% 20-24/06/2026 | EUR | 95 087 | 0,05 |
| 167 000 | BMW FINANCE NV 3,625% 23-22/05/2035 | EUR | 173 517 | 0,10 | 920 000 | KFW 0,375% 21-20/05/2036 | EUR | 695 038 | 0,39 |
| 100 000 | COOPERATIEVE RAB 4,000% 23-10/01/2030 | EUR | 103 242 | 0,06 | 1 000 000 | KFW 1,125% 17-15/06/2037 | EUR | 816 348 | 0,45 |
| 100 000 | DIAGEO CAPITAL 1,500% 22-08/06/2029 | EUR | 92 964 | 0,05 | 280 000 | KFW 1,250% 16-04/07/2036 | EUR | 235 556 | 0,13 |
| 301 000 | EASYJET FINCO 1,875% 21-03/03/2028 | EUR | 280 950 | 0,16 | 260 000 | NORDRHEIN-WEST 1,000% 16-16/10/2046 | EUR | 175 169 | 0,10 |
| 175 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 0,375% 19-17/06/2027 | EUR | 159 317 | 0,09 | 340 000 | NORDRHEIN-WEST 1,650% 17-16/05/2047 | EUR | 263 264 | 0,15 |
| 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4,000% 23-20/02/2031 | EUR | 103 312 | 0,06 | 480 000 | NORDRHEIN-WEST 1,750% 17-26/10/2057 | EUR | 347 163 | 0,19 |
| 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4,500% 23-20/02/2043 | EUR | 102 936 | 0,06 | 2 670 000 | NRW BANK 0,250% 22-26/01/2032 | EUR | 2 222 847 | 1,23 |
| 1 700 000 | ING BANK NV 0,750% 19-18/02/2029 | EUR | 1 545 538 | 0,86 | 1 850 000 | UNICREDIT 0,010% 20-15/09/2028 | EUR | 1 636 929 | 0,91 |
| 1 560 000 | ING GROEP NV 6,500% 15-29/12/2049 | USD | 1 381 548 | 0,77 | 100 000 | VIER GAS TRANSPO 4,625% 22-26/09/2032 | EUR | 108 784 | 0,06 |
| 100 000 | KONINKLIJKE KPN 0,875% 20-14/12/2032 | EUR | 81 416 | 0,05 | 298 000 | VOLKSWAGEN LEAS 0,375% 21-20/07/2026 | EUR | 276 134 | 0,15 |
| 250 000 | NED WATERSCHAPBK 0,000% 19-02/10/2034 | EUR | 186 559 | 0,10 | 100 000 | VONOVIA SE 0,000% 21-01/12/2025 | EUR | 93 211 | 0,05 |
| 570 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 0,250% 19-15/07/2029 | EUR | 514 773 | 0,29 | 200 000 | VONOVIA SE 0,750% 21-01/09/2032 | EUR | 151 665 | 0,08 |
| 1 270 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 3,750% 10-15/01/2042 | EUR | 1 498 549 | 0,83 | 100 000 | VONOVIA SE 4,750% 22-23/05/2027 | EUR | 103 577 | 0,06 |
| 620 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 4,000% 05-15/01/2037 | EUR | 724 141 | 0,40 | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>7 466 243</i> | <i>4,15</i> |
| 1 370 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 5,500% 08-15/01/2028 | EUR | 1 544 209 | 0,86 | 100 000 | ASTRAZENECA PLC 3,625% 23-03/03/2027 | EUR | 102 243 | 0,06 |
| 1 500 000 | NN BANK NV 0,010% 20-08/07/2030 | EUR | 1 256 075 | 0,70 | 100 000 | BRITISH TELECOMM 4,250% 23-06/01/2033 | EUR | 105 230 | 0,06 |
| 100 000 | ROCHE FINANCE EU 3,312% 23-04/12/2027 | EUR | 102 295 | 0,06 | 200 000 | CREDIT AGRICOLE 1,250% 16-14/04/2026 | EUR | 191 552 | 0,11 |
| 100 000 | SANDOZ FINANCE 4,500% 23-17/11/2033 | EUR | 105 981 | 0,06 | 100 000 | GSK CAPITAL BV 3,000% 22-28/11/2027 | EUR | 100 726 | 0,06 |
| 200 000 | SARTORIUS FIN 4,500% 23-14/09/2032 | EUR | 208 253 | 0,12 | 100 000 | GSK CAPITAL BV 3,125% 22-28/11/2032 | EUR | 101 033 | 0,06 |
| 200 000 | STELLANTIS NV 4,250% 23-16/06/2031 | EUR | 207 305 | 0,11 | 100 000 | LINDE PLC 3,375% 23-12/06/2029 | EUR | 102 677 | 0,06 |
| 161 000 | THERMO FISHER 0,800% 21-18/10/2030 | EUR | 139 568 | 0,08 | 100 000 | NATIONAL GRID PLC 0,250% 21-01/09/2028 | EUR | 87 225 | 0,05 |
| 100 000 | UNILEVER FINANCE 1,750% 22-16/11/2028 | EUR | 95 429 | 0,05 | 132 000 | TESCO CORP TREAS 0,375% 21-27/07/2029 | EUR | 111 945 | 0,06 |
| 200 000 | VOLKSWAGEN INTFN 0,875% 20-22/09/2028 | EUR | 178 745 | 0,10 | 100 000 | TESCO CORP TREAS 4,250% 23-27/02/2031 | EUR | 103 832 | 0,06 |
| 300 000 | VONOVIA BV 0,500% 19-14/09/2029 | EUR | 246 964 | 0,14 | 5 810 000 | UK TREASURY GILT 3,750% 23-22/10/2053 | GBP | 6 255 051 | 3,46 |
| | <i>Italie</i> | | <i>9 830 682</i> | <i>5,43</i> | 210 000 | UNILEVER NV 1,250% 20-25/03/2025 | EUR | 204 729 | 0,11 |
| 100 000 | AEROPORTI ROMA 4,875% 23-10/07/2033 | EUR | 105 209 | 0,06 | | <i>Luxembourg</i> | | <i>4 481 321</i> | <i>2,48</i> |
| 200 000 | ASSICURAZIONI 5,272% 23-12/09/2033 | EUR | 210 598 | 0,12 | 200 000 | DH EUROPE 0,450% 19-18/03/2028 | EUR | 180 550 | 0,10 |
| 100 000 | AUTOSTRADA PER L 5,125% 23-14/06/2033 | EUR | 104 504 | 0,06 | 1 290 000 | EIB 0,875% 18-14/01/2028 | EUR | 1 216 496 | 0,67 |
| 100 000 | BANCO BPM SPA 4,625% 23-29/11/2027 | EUR | 102 968 | 0,06 | 1 300 000 | EIB 4,000% 05-15/10/2037 | EUR | 1 473 388 | 0,82 |
| 100 000 | ENI SPA 4,250% 23-19/05/2033 | EUR | 104 837 | 0,06 | 1 010 000 | ESM 1,800% 17-02/11/2046 | EUR | 816 199 | 0,45 |
| 200 000 | INTESA SANPAOLO 5,125% 23-29/08/2031 | EUR | 212 959 | 0,12 | 52 000 | HEIDELBERG MATR 4,875% 23-21/11/2033 | EUR | 55 378 | 0,03 |
| 180 000 | ITALY BTPS 1,700% 20-01/09/2051 | EUR | 109 096 | 0,06 | 322 000 | LUXEMBOURG GOVERNMENT 0,000% 19-13/11/2026 | EUR | 300 962 | 0,17 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 72 000 | NESTLE FIN INTL 3,500% 23-17/01/2030 | EUR | 75 012 | 0,04 | | | | | |
| 100 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 4,625% 23-21/02/2035 | EUR | 104 034 | 0,06 | 180 000 | Slovaquie SLOVAKIA GOVERNMENT 1,625% 16-21/01/2031 | EUR | 886 022 | 0,49 |
| 300 000 | REPSOL EUROPE 0,375% 21-06/07/2029 | EUR | 259 302 | 0,14 | 250 000 | SLOVAKIA GOVERNMENT 2,000% 17-17/10/2047 | EUR | 164 196 | 0,09 |
| | <i>Afrique du Sud</i> | | <i>4 056 654</i> | <i>2,24</i> | 170 138 | SLOVAKIA GOVERNMENT 3,625% 14-16/01/2029 | EUR | 183 963 | 0,10 |
| 93 850 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8,250% 13-31/03/2032 | ZAR | 4 056 654 | 2,24 | 350 000 | SLOVAKIA GOVERNMENT 3,625% 23-08/06/2033 | EUR | 175 429 | 0,10 |
| | <i>Roumanie</i> | | <i>2 551 476</i> | <i>1,41</i> | | | | <i>692 383</i> | <i>0,38</i> |
| 310 000 | ROMANIA 4,625% 19-03/04/2049 | EUR | 259 836 | 0,14 | 470 000 | Slovénie REPUBLIC OF SLOVENIA 1,750% 16-03/11/2040 | EUR | 378 012 | 0,21 |
| 11 130 000 | ROMANIA 6,700% 22-25/02/2032 | RON | 2 291 640 | 1,27 | 330 000 | REPUBLIC OF SLOVENIA 2,250% 16-03/03/2032 | EUR | 314 371 | 0,17 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>2 179 252</i> | <i>1,20</i> | | | | <i>633 719</i> | <i>0,35</i> |
| 220 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 1,500% 16-20/02/2047 | EUR | 168 733 | 0,09 | 770 000 | Rép. dominicaine REPUBLIC OF DOMINICAN 4,875% 20-23/09/2032 | USD | 633 719 | 0,35 |
| 790 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 2,400% 13-23/05/2034 | EUR | 772 870 | 0,43 | | | | <i>620 346</i> | <i>0,34</i> |
| 250 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 3,150% 12-20/06/2044 | EUR | 260 429 | 0,14 | 990 000 | Egypte ARAB REP EGYPT 7,625% 20-29/05/2032 | USD | 620 346 | 0,34 |
| 530 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 3,800% 12-26/01/2062 | EUR | 633 715 | 0,35 | | | | <i>563 219</i> | <i>0,31</i> |
| 300 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 4,150% 07-15/03/2037 | EUR | 343 505 | 0,19 | 670 000 | Côte d'Ivoire IVORY COAST-PDI 4,875% 20-30/01/2032 | EUR | 563 219 | 0,31 |
| | <i>Pérou</i> | | <i>2 140 618</i> | <i>1,19</i> | | | | <i>527 812</i> | <i>0,29</i> |
| 8 380 000 | REPUBLIC OF PERU 7,300% 23-12/08/2033 | PEN | 2 140 618 | 1,19 | 570 000 | Serbie SERBIA REPUBLIC 6,500% 23-26/09/2033 | USD | 527 812 | 0,29 |
| | <i>Portugal</i> | | <i>1 875 129</i> | <i>1,04</i> | | | | <i>494 192</i> | <i>0,28</i> |
| 1 030 000 | PORTUGUESE OTS 1,950% 19-15/06/2029 | EUR | 1 012 851 | 0,56 | 280 000 | Croatie CROATIA 1,500% 20-17/06/2031 | EUR | 250 317 | 0,14 |
| 250 000 | PORTUGUESE OTS 2,875% 16-21/07/2026 | EUR | 254 518 | 0,14 | 250 000 | CROATIA 2,875% 22-22/04/2032 | EUR | 243 875 | 0,14 |
| 70 000 | PORTUGUESE OTS 3,875% 14-15/02/2030 | EUR | 75 978 | 0,04 | | | | <i>433 871</i> | <i>0,25</i> |
| 110 000 | PORTUGUESE OTS 4,100% 06-15/04/2037 | EUR | 122 998 | 0,07 | 300 000 | Chine CHINA (PEOPLES) 0,250% 20-25/11/2030 | EUR | 248 427 | 0,14 |
| 360 000 | PORTUGUESE OTS 4,100% 15-15/02/2045 | EUR | 408 784 | 0,23 | 1 600 000 | CHINA EVERGRANDE 8,750% 17-28/06/2025 | USD | 14 484 | 0,01 |
| | <i>Canada</i> | | <i>1 519 882</i> | <i>0,84</i> | 1 870 000 | COUNTRY GARDEN 3,125% 20-22/10/2025 | USD | 135 428 | 0,08 |
| 1 050 000 | BANK OF MONTREAL 0,125% 22-26/01/2027 | EUR | 962 781 | 0,53 | 3 140 000 | TIMES CN HLDG 6,750% 20-08/07/2025 | USD | 35 532 | 0,02 |
| 110 000 | MERCEDES-BENZ CA FIN 3,000% 22-23/02/2027 | EUR | 110 074 | 0,06 | | | | <i>389 653</i> | <i>0,22</i> |
| 490 000 | ONTARIO TEACHERS 1,850% 22-03/05/2032 | EUR | 447 027 | 0,25 | 910 000 | Bolivie BOLIVIA GOVERNMENT 4,500% 17-20/03/2028 | USD | 389 653 | 0,22 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>1 327 863</i> | <i>0,73</i> | | | | <i>305 573</i> | <i>0,17</i> |
| 360 000 | IRISH GOVERNMENT 0,350% 22-18/10/2032 | EUR | 306 360 | 0,17 | 390 000 | Mexique UNITED MEXICAN 2,250% 21-12/08/2036 | EUR | 305 573 | 0,17 |
| 630 000 | IRISH GOVERNMENT 1,350% 18-18/03/2031 | EUR | 588 231 | 0,33 | | | | <i>263 178</i> | <i>0,14</i> |
| 130 000 | IRISH GOVERNMENT 1,500% 19-15/05/2050 | EUR | 98 544 | 0,05 | 100 000 | Japon NIDEC CORP 0,046% 21-30/03/2026 | EUR | 92 188 | 0,05 |
| 210 000 | IRISH GOVERNMENT 1,700% 17-15/05/2037 | EUR | 188 015 | 0,10 | 200 000 | TAKEDA PHARM 1,375% 20-09/07/2032 | EUR | 170 990 | 0,09 |
| 170 000 | IRISH GOVERNMENT 2,000% 15-18/02/2045 | EUR | 146 713 | 0,08 | | | | <i>246 125</i> | <i>0,14</i> |
| | <i>Bahreïn</i> | | <i>1 242 598</i> | <i>0,69</i> | | | | <i>68 436</i> | <i>0,04</i> |
| 1 545 000 | BAHRAIN 5,250% 21-25/01/2033 | USD | 1 242 598 | 0,69 | 170 000 | Lituanie LITHUANIA 0,500% 20-28/07/2050 | EUR | 177 689 | 0,10 |
| | <i>Finlande</i> | | <i>1 163 819</i> | <i>0,65</i> | | | | <i>191 003</i> | <i>0,11</i> |
| 850 000 | FINNISH GOVERNMENT 0,250% 20-15/09/2040 | EUR | 563 003 | 0,31 | 250 000 | Hongrie REPUBLIC OF HUNGARY 1,750% 20-05/06/2035 | EUR | 191 003 | 0,11 |
| 240 000 | FINNISH GOVERNMENT 1,125% 18-15/04/2034 | EUR | 208 161 | 0,12 | | | | <i>174 776</i> | <i>0,10</i> |
| 120 000 | FINNISH GOVERNMENT 2,625% 12-04/07/2042 | EUR | 116 584 | 0,06 | 200 000 | Pologne REPUBLIC OF POLAND 2,375% 16-18/01/2036 | EUR | 174 776 | 0,10 |
| 100 000 | NOKIA OYJ 4,375% 23-21/08/2031 | EUR | 100 547 | 0,06 | | | | <i>154 239</i> | <i>0,09</i> |
| 200 000 | NORDEA BANK ABP 0,500% 21-02/11/2028 | EUR | 175 524 | 0,10 | 170 000 | Philippines ASIAN DEV BANK 2,000% 22-10/06/2037 | EUR | 154 239 | 0,09 |
| | <i>Sénégal</i> | | <i>1 064 251</i> | <i>0,59</i> | | | | <i>132 244</i> | <i>0,07</i> |
| 1 320 000 | REPUBLIC OF SENEGAL 6,250% 17-23/05/2033 | USD | 1 064 251 | 0,59 | 180 000 | Cameroun REPUBLIC OF CAMEROON 5,950% 21-07/07/2032 | EUR | 132 244 | 0,07 |
| | <i>Colombie</i> | | <i>978 387</i> | <i>0,54</i> | | | | <i>106 324</i> | <i>0,06</i> |
| 1 360 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 3,250% 21-22/04/2032 | USD | 978 387 | 0,54 | 100 000 | Danemark CARLSBERG BREW 4,250% 23-05/10/2033 | EUR | 106 324 | 0,06 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Norvège</i> | | <i>105 241</i> | <i>0,06</i> | | | | | |
| 100 000 | SPAREBANK 1 SR 4,875% 23-24/08/2028 | EUR | 105 241 | 0,06 | 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA 21-21/09/2029 FRN | EUR | 87 128 | 0,05 |
| | <i>Hong-Kong</i> | | <i>89 033</i> | <i>0,05</i> | 100 000 | CREDIT AGRICOLE SA 22-22/04/2027 FRN | EUR | 96 382 | 0,05 |
| 2 810 000 | SHIMAO PROPERTY 5,200% 18-30/01/2025 | USD | 89 033 | 0,05 | 200 000 | ORANGE 20-15/10/2169 FRN | EUR | 177 070 | 0,10 |
| | <i>Chili</i> | | <i>83 726</i> | <i>0,05</i> | 100 000 | SOCIETE GENERALE 22-06/12/2030 FRN | EUR | 101 559 | 0,06 |
| 150 000 | CHILE 1,250% 21-22/01/2051 | EUR | 83 726 | 0,05 | 100 000 | VEOLIA ENVRNMT 23-22/02/2172 FRN | EUR | 104 891 | 0,06 |
| | Obligations à taux flottant | | 16 173 014 | 8,96 | | <i>Allemagne</i> | | <i>794 947</i> | <i>0,43</i> |
| | <i>Espagne</i> | | <i>5 500 907</i> | <i>3,06</i> | 100 000 | COMMERZBANK AG 20-24/03/2026 FRN | EUR | 95 969 | 0,05 |
| 100 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 23-13/01/2031 FRN | EUR | 104 901 | 0,06 | 100 000 | COMMERZBANK AG 22-06/12/2032 FRN | EUR | 105 506 | 0,06 |
| 100 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 23-15/09/2033 FRN | EUR | 105 082 | 0,06 | 100 000 | COMMERZBANK AG 23-05/10/2033 FRN | EUR | 106 515 | 0,06 |
| 100 000 | BANCO SABADELL 21-16/06/2028 FRN | EUR | 90 268 | 0,05 | 200 000 | DEUTSCHE BANK AG 21-17/02/2027 FRN | EUR | 186 635 | 0,10 |
| 100 000 | BANCO SABADELL 23-07/06/2029 FRN | EUR | 105 014 | 0,06 | 200 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-05/09/2030 FRN | EUR | 206 378 | 0,11 |
| 100 000 | BANCO SABADELL 23-08/09/2029 FRN | EUR | 103 929 | 0,06 | 100 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-23/02/2028 FRN | EUR | 93 944 | 0,05 |
| 100 000 | BANCO SABADELL 23-16/08/2033 FRN | EUR | 101 109 | 0,06 | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>736 953</i> | <i>0,41</i> |
| 1 400 000 | BANCO SANTANDER 19-31/12/2049 FRN | USD | 1 266 292 | 0,70 | 100 000 | HSBC HOLDINGS 23/05/2033 FRN | EUR | 105 966 | 0,06 |
| 100 000 | BANCO SANTANDER 21-24/06/2029 FRN | EUR | 88 461 | 0,05 | 157 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 22-24/08/2030 FRN | EUR | 152 798 | 0,08 |
| 100 000 | BANCO SANTANDER 23-23/08/2033 FRN | EUR | 104 745 | 0,06 | 100 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 23-21/09/2031 FRN | EUR | 105 600 | 0,06 |
| 200 000 | BANKINTER SA 21-23/12/2032 FRN | EUR | 178 038 | 0,10 | 185 000 | SANTANDER UK GRP 21-13/09/2029 FRN | EUR | 158 894 | 0,09 |
| 1 400 000 | CAIXABANK 17-31/12/2049 FRN | EUR | 1 396 586 | 0,77 | 200 000 | VODAFONE GROUP 23-30/08/2084 FRN | EUR | 213 695 | 0,12 |
| 1 600 000 | CAIXABANK 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 547 889 | 0,86 | | <i>Irlande</i> | | <i>406 659</i> | <i>0,23</i> |
| 100 000 | CAIXABANK 22-13/04/2026 FRN | EUR | 97 287 | 0,05 | 211 000 | BANK OF IRELAND 21-10/05/2027 FRN | EUR | 196 112 | 0,11 |
| 200 000 | CAIXABANK 23-30/05/2034 FRN | EUR | 211 306 | 0,12 | 100 000 | BANK OF IRELAND 23-04/07/2031 FRN | EUR | 106 685 | 0,06 |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>2 321 868</i> | <i>1,28</i> | 100 000 | BANK OF IRELAND 23-13/11/2029 FRN | EUR | 103 862 | 0,06 |
| 200 000 | ABERTIS FINANCE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 181 961 | 0,10 | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>251 426</i> | <i>0,14</i> |
| 134 000 | ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES 21-21/03/2082 FRN | EUR | 115 962 | 0,06 | 313 000 | JPMORGAN CHASE 21-17/02/2033 FRN | EUR | 251 426 | 0,14 |
| 200 000 | COOPERATIEVE RAB 22-30/11/2032 FRN | EUR | 199 865 | 0,11 | | <i>Suisse</i> | | <i>175 632</i> | <i>0,10</i> |
| 100 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 84 715 | 0,05 | 200 000 | UBS GROUP 20-05/11/2028 FRN | EUR | 175 632 | 0,10 |
| 100 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 90 875 | 0,05 | | <i>Japon</i> | | <i>172 655</i> | <i>0,10</i> |
| 100 000 | ING GROEP NV 21-09/06/2032 FRN | EUR | 89 790 | 0,05 | 200 000 | MIZUHO FINANCIAL 21-06/09/2029 FRN | EUR | 172 655 | 0,10 |
| 1 660 000 | ING GROEP NV 21-31/12/2061 FRN | USD | 1 213 718 | 0,67 | | <i>Danemark</i> | | <i>105 349</i> | <i>0,06</i> |
| 130 000 | NN GROUP NV 17-13/01/2048 FRN | EUR | 129 920 | 0,07 | 100 000 | DANSKE BANK A/S 23-21/06/2030 FRN | EUR | 105 349 | 0,06 |
| 100 000 | TELEFONICA EUROP 23-07/09/2172 FRN | EUR | 106 572 | 0,06 | | <i>Grèce</i> | | <i>104 833</i> | <i>0,06</i> |
| 100 000 | VOLKSWAGEN INTFN 23-06/09/2172 FRN | EUR | 108 490 | 0,06 | 100 000 | PIRAEUS BANK 23-05/12/2029 FRN | EUR | 104 833 | 0,06 |
| | <i>Italie</i> | | <i>2 054 023</i> | <i>1,12</i> | | <i>Portugal</i> | | <i>103 616</i> | <i>0,06</i> |
| 1 130 000 | INTESA SANPAOLO 20-01/03/2169 FRN | EUR | 1 017 947 | 0,56 | 100 000 | EDP SA 23/04/2083 FRN | EUR | 103 616 | 0,06 |
| 200 000 | INTESA SANPAOLO 23-07/03/2172 FRN | EUR | 219 816 | 0,12 | | <i>Autriche</i> | | <i>93 268</i> | <i>0,05</i> |
| 200 000 | INTESA SANPAOLO 23-08/03/2028 FRN | EUR | 206 832 | 0,11 | 100 000 | ERSTE GROUP 20-08/09/2031 FRN | EUR | 93 268 | 0,05 |
| 129 000 | TERNA RETE 22-09/02/2171 FRN | EUR | 115 196 | 0,06 | | Obligations à taux flottants | | 2 814 431 | 1,56 |
| 200 000 | UNICREDIT SPA 20-15/01/2032 FRN | EUR | 187 428 | 0,10 | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>2 814 431</i> | <i>1,56</i> |
| 228 000 | UNICREDIT SPA 21-05/07/2029 FRN | EUR | 202 517 | 0,11 | 729 898 | STACR 2020-DNA6 M2 20-25/12/2050 FRN | USD | 665 871 | 0,37 |
| 100 000 | UNICREDIT SPA 23-14/02/2030 FRN | EUR | 104 287 | 0,06 | 400 000 | STACR 2021-DNA3 M2 21-25/10/2033 FRN | USD | 363 246 | 0,20 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>1 984 970</i> | <i>1,10</i> | 400 000 | STACR 2021-DNA7 M2 21-25/11/2041 FRN | USD | 357 561 | 0,20 |
| 2 200 000 | BELFIUS BANK SA 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 887 842 | 1,05 | 481 284 | STACR 2021-HQA4 M1 21-25/12/2041 FRN | USD | 430 256 | 0,24 |
| 100 000 | KBC GROUP NV 22-29/03/2026 FRN | EUR | 97 128 | 0,05 | 600 000 | STACR 2022-HQA3 M1B 22-25/08/2042 FRN | USD | 561 561 | 0,31 |
| | <i>France</i> | | <i>1 365 908</i> | <i>0,76</i> | 477 436 | STACR 2023-HQA2 M1A 23-25/06/2043 FRN | USD | 435 936 | 0,24 |
| 100 000 | ACCOR 23-11/04/2172 FRN | EUR | 108 482 | 0,06 | | | | | |
| 100 000 | BNP PARIBAS 21-13/04/2027 FRN | EUR | 92 649 | 0,05 | | | | | |
| 200 000 | BNP PARIBAS 22-06/06/2171 FRN | EUR | 206 973 | 0,11 | | | | | |
| 100 000 | BNP PARIBAS 23/02/2029 FRN | EUR | 102 143 | 0,06 | | | | | |
| 100 000 | BNP PARIBAS 23-26/09/2032 FRN | EUR | 104 661 | 0,06 | | | | | |
| 100 000 | BPCE 22-14/01/2028 FRN | EUR | 91 227 | 0,05 | | | | | |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 18-29/01/2048 FRN | EUR | 92 743 | 0,05 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Autres valeurs mobilières | | 143 145 | 0,08 |
| | Obligations | | 143 145 | 0,08 |
| | <i>Chine</i> | | <i>143 145</i> | <i>0,08</i> |
| 2 750 000 | CHINA SCE GRP 7,000% 20-02/05/2025 DFLT | USD | 143 145 | 0,08 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 4 625 825 | 2,56 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>2 829 416</i> | <i>1,56</i> |
| 30,00 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ASIAN CITIES BOND - X CAP | USD | 2 829 416 | 1,56 |
| | <i>France</i> | | <i>1 796 409</i> | <i>1,00</i> |
| 175,11 | BNP PARIBAS INVEST 3 MOIS - X | EUR | 1 796 409 | 1,00 |
| | Total portefeuille-titres | | 166 597 377 | 92,29 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 702 748 686 | 65,43 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 2 000 000 | ACCOR 1,750% 19-04/02/2026 | EUR | 1 921 320 | 0,18 | 4 500 000 | SUEZ 2,375% 22-24/05/2030 | EUR | 4 238 604 | 0,39 |
| 4 000 000 | APRR SA 1,875% 22-03/01/2029 | EUR | 3 808 205 | 0,35 | 1 900 000 | SUEZ 4,500% 23-13/11/2033 | EUR | 2 026 176 | 0,19 |
| 3 800 000 | ARKEMA 4,250% 23-20/05/2030 | EUR | 3 966 258 | 0,37 | 6 000 000 | SUEZ 4,625% 22-03/11/2028 | EUR | 6 347 727 | 0,59 |
| 1 000 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 1,625% 17-15/11/2027 | EUR | 928 751 | 0,09 | 1 300 000 | TELEPERFORMANCE 5,250% 23-22/11/2028 | EUR | 1 358 604 | 0,13 |
| 10 900 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,750% 23-10/11/2031 | EUR | 11 556 230 | 1,08 | 2 200 000 | TELEPERFORMANCE 5,750% 23-22/11/2031 | EUR | 2 334 237 | 0,22 |
| 1 700 000 | BOUYGUES SA 5,375% 22-30/06/2042 | EUR | 2 014 555 | 0,19 | 5 000 000 | THALES SA 4,250% 23-18/10/2031 | EUR | 5 309 365 | 0,49 |
| 1 500 000 | CAPGEMINI SE 1,125% 20-23/06/2030 | EUR | 1 337 837 | 0,12 | 2 000 000 | TOTAL CAP INTERNATIONAL 1,375% 17-04/10/2029 | EUR | 1 836 109 | 0,17 |
| 4 800 000 | CARMILA SA 5,500% 23-09/10/2028 | EUR | 4 977 105 | 0,46 | 1 500 000 | UNIBAIL-RODAMCO 1,375% 15-15/04/2030 | EUR | 1 318 376 | 0,12 |
| 6 200 000 | CARREFOUR BANQUE 4,079% 23-05/05/2027 | EUR | 6 289 990 | 0,59 | 6 000 000 | URW 4,125% 23-11/12/2030 | EUR | 6 174 762 | 0,57 |
| 2 000 000 | CARREFOUR SA 3,750% 23-10/10/2030 | EUR | 2 039 033 | 0,19 | 1 000 000 | VEOLIA ENVIRONNEMENT 1,590% 15-10/01/2028 | EUR | 943 444 | 0,09 |
| 3 100 000 | CARREFOUR SA 4,375% 23-14/11/2031 | EUR | 3 284 794 | 0,31 | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 4 400 000 | CIE DE ST GOBAIN 3,750% 23-29/11/2026 | EUR | 4 471 797 | 0,42 | 2 600 000 | ABBOTT IL FIN 0,375% 19-19/11/2027 | EUR | 2 380 176 | 0,22 |
| 3 000 000 | COFACE SA 5,750% 23-28/11/2033 | EUR | 3 108 418 | 0,29 | 5 000 000 | ABBVIE INC 2,125% 20-01/06/2029 | EUR | 4 769 845 | 0,44 |
| 5 100 000 | COVVIO 4,625% 23-05/06/2032 | EUR | 5 287 341 | 0,49 | 3 000 000 | ABBVIE INC 2,625% 20-15/11/2028 | EUR | 2 945 019 | 0,27 |
| 1 400 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 1,500% 21-06/10/2031 | EUR | 1 143 037 | 0,11 | 1 900 000 | AT&T INC 1,600% 20-19/05/2028 | EUR | 1 783 213 | 0,17 |
| 2 300 000 | CREDIT AGRICOLE SA 2,000% 19-25/03/2029 | EUR | 2 127 915 | 0,20 | 4 011 000 | AT&T INC 2,600% 14-17/12/2029 | EUR | 3 865 556 | 0,36 |
| 3 900 000 | CREDIT AGRICOLE SA 2,500% 22-29/08/2029 | EUR | 3 755 104 | 0,35 | 2 500 000 | AT&T INC 3,500% 13-17/12/2025 | EUR | 2 504 496 | 0,23 |
| 3 000 000 | CREDIT AGRICOLE SA 3,375% 22-28/07/2027 | EUR | 3 019 133 | 0,28 | 2 588 000 | BOOKING HLDS INC 3,625% 23-12/11/2028 | EUR | 2 658 547 | 0,25 |
| 4 000 000 | DANONE 3,470% 23-22/05/2031 | EUR | 4 103 049 | 0,38 | 2 185 000 | CARRIER GLOBAL 4,125% 23-29/05/2028 | EUR | 2 247 230 | 0,21 |
| 5 900 000 | DANONE 3,706% 23-13/11/2029 | EUR | 6 146 827 | 0,57 | 3 000 000 | CITIGROUP INC 1,500% 16-26/10/2028 | EUR | 2 761 025 | 0,26 |
| 2 100 000 | EDENRED 3,625% 23-13/06/2031 | EUR | 2 135 517 | 0,20 | 5 011 000 | FORD MOTOR CREDIT 5,125% 23-20/02/2029 | EUR | 5 238 617 | 0,49 |
| 2 800 000 | EDENRED 3,625% 23-13/12/2026 | EUR | 2 836 535 | 0,26 | 3 000 000 | FORD MOTOR CREDIT 6,125% 23-15/05/2028 | EUR | 3 239 134 | 0,30 |
| 1 000 000 | ELO SACA 4,875% 22-08/12/2028 | EUR | 987 815 | 0,09 | 3 410 000 | GENERAL MOTORS FIN 0,650% 21-07/09/2028 | EUR | 2 997 413 | 0,28 |
| 4 600 000 | ELO SACA 6,000% 23-22/03/2029 | EUR | 4 663 115 | 0,43 | 4 000 000 | GOLDMAN SACHS GROUP 0,875% 21-09/05/2029 | EUR | 3 477 595 | 0,32 |
| 2 500 000 | ENGIE 1,750% 20-27/03/2028 | EUR | 2 370 518 | 0,22 | 4 000 000 | IBM CORP 0,300% 20-11/02/2028 | EUR | 3 600 440 | 0,34 |
| 1 800 000 | ENGIE 3,625% 23-06/12/2026 | EUR | 1 824 909 | 0,17 | 3 000 000 | IBM CORP 3,375% 23-06/02/2027 | EUR | 3 034 997 | 0,28 |
| 3 000 000 | ENGIE 3,750% 23-06/09/2027 | EUR | 3 060 333 | 0,28 | 4 000 000 | IBM CORP 4,000% 23-06/02/2043 | EUR | 4 153 274 | 0,39 |
| 2 000 000 | ENGIE 3,875% 23-06/01/2031 | EUR | 2 067 779 | 0,19 | 1 731 000 | IHG FINANCE LLC 4,375% 23-28/11/2029 | EUR | 1 792 887 | 0,17 |
| 2 000 000 | ENGIE 4,000% 23-11/01/2035 | EUR | 2 077 583 | 0,19 | 3 070 000 | MCDONALDS CORP 3,875% 23-20/02/2031 | EUR | 3 185 784 | 0,30 |
| 6 000 000 | GECINA 1,375% 17-26/01/2028 | EUR | 5 619 812 | 0,52 | 1 500 000 | MERCK & CO INC 1,875% 14-15/10/2026 | EUR | 1 456 180 | 0,14 |
| 3 000 000 | HOLDING DINFRA 2,500% 20-04/05/2027 | EUR | 2 908 275 | 0,27 | 6 000 000 | MYLAN NV 3,125% 16-22/11/2028 | EUR | 5 830 705 | 0,54 |
| 5 000 000 | HOLDING DINFRA 4,250% 23-18/03/2030 | EUR | 5 136 002 | 0,48 | 2 000 000 | NETFLIX INC 3,875% 19-15/11/2029 | EUR | 2 065 256 | 0,19 |
| 3 000 000 | ICADE SANTE SAS 0,875% 19-04/11/2029 | EUR | 2 477 587 | 0,23 | 1 000 000 | PEPSICO INC 1,125% 19-18/03/2031 | EUR | 890 665 | 0,08 |
| 7 600 000 | KERING 3,625% 23-05/09/2027 | EUR | 7 765 657 | 0,72 | 2 000 000 | PFIZER INC 1,000% 17-06/03/2027 | EUR | 1 891 776 | 0,18 |
| 1 500 000 | KERING 3,875% 23-05/09/2035 | EUR | 1 571 111 | 0,15 | 1 372 000 | REALTY INCOME 4,875% 23-06/07/2030 | EUR | 1 452 535 | 0,14 |
| 1 500 000 | KLEPIERRE 0,625% 19-01/07/2030 | EUR | 1 247 193 | 0,12 | 1 848 000 | STRYKER CORP 3,375% 23-11/12/2028 | EUR | 1 872 851 | 0,17 |
| 7 500 000 | LOREAL SA 2,875% 23-19/05/2028 | EUR | 7 534 112 | 0,70 | 1 000 000 | THERMO FISHER 1,375% 16-12/09/2028 | EUR | 933 677 | 0,09 |
| 4 500 000 | LOREAL SA 3,375% 23-23/11/2029 | EUR | 4 636 600 | 0,43 | 3 000 000 | THERMO FISHER 1,950% 17-24/07/2029 | EUR | 2 845 369 | 0,26 |
| 2 500 000 | LVMH MOET HENNESSY 3,250% 23-07/09/2029 | EUR | 2 543 683 | 0,24 | 5 000 000 | UNILEVER CAPITAL 3,300% 23-06/06/2029 | EUR | 5 109 608 | 0,48 |
| 2 000 000 | MICHELIN 1,750% 18-03/09/2030 | EUR | 1 865 066 | 0,17 | 1 613 000 | VERALTO CORP 4,150% 23-19/09/2031 | EUR | 1 676 544 | 0,16 |
| 4 500 000 | ORANGE 1,375% 18-20/03/2028 | EUR | 4 239 742 | 0,39 | 2 000 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0,875% 19-08/04/2027 | EUR | 1 868 481 | 0,17 |
| 4 000 000 | ORANGE 3,625% 22-16/11/2031 | EUR | 4 172 646 | 0,39 | 2 000 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1,375% 17-27/10/2026 | EUR | 1 912 364 | 0,18 |
| 1 000 000 | PERNOD RICARD SA 1,375% 22-07/04/2029 | EUR | 925 498 | 0,09 | 2 000 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 4,250% 22-31/10/2030 | EUR | 2 119 265 | 0,20 |
| 1 100 000 | PRAEMIA HEALTHCR 5,500% 23-19/09/2028 | EUR | 1 150 118 | 0,11 | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 1 843 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-02/10/2026 | EUR | 1 889 224 | 0,18 | 5 000 000 | ABN AMRO BANK NV 4,375% 23-20/10/2028 | EUR | 5 182 738 | 0,48 |
| 7 346 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-02/10/2029 | EUR | 7 719 975 | 0,72 | 1 500 000 | ABN AMRO BANK NV 5,500% 23-21/09/2033 | EUR | 1 569 025 | 0,15 |
| 4 000 000 | SANOFI 1,250% 22-06/04/2029 | EUR | 3 719 162 | 0,35 | 4 200 000 | AHOLD DELHAIZE 0,375% 21-18/03/2030 | EUR | 3 553 298 | 0,33 |
| 3 000 000 | SANOFI 1,375% 18-21/03/2030 | EUR | 2 765 849 | 0,26 | 3 000 000 | AHOLD DELHAIZE 3,500% 23-04/04/2028 | EUR | 3 058 518 | 0,28 |
| 1 000 000 | SOCIETE GENERALE 4,250% 23-28/09/2026 | EUR | 1 024 516 | 0,10 | 1 102 000 | ASR NEDERLAND NV 3,625% 23-12/12/2028 | EUR | 1 116 438 | 0,10 |
| 2 000 000 | SOCIETE GENERALE 5,625% 23-02/06/2033 | EUR | 2 131 570 | 0,20 | 2 586 000 | BMW FINANCE NV 3,875% 23-04/10/2028 | EUR | 2 700 531 | 0,25 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 2 615 000 | BMW FINANCE NV 4,125% 23-04/10/2033 | EUR | 2 816 567 | 0,26 | 3 000 000 | BANCO SABADELL 5,625% 16-06/05/2026 | EUR | 3 059 822 | 0,28 |
| 3 100 000 | DAIMLER TRUCK 3,875% 23-19/06/2026 | EUR | 3 150 751 | 0,29 | 5 000 000 | BANCO SANTANDER 4,875% 23-18/10/2031 | EUR | 5 322 401 | 0,50 |
| 5 200 000 | DEUTSCHE TEL FIN 1,500% 16-03/04/2028 | EUR | 4 930 565 | 0,46 | 6 800 000 | CAIXABANK 4,250% 23-06/09/2030 | EUR | 7 060 410 | 0,66 |
| 3 000 000 | EASYJET FINCO 1,875% 21-03/03/2028 | EUR | 2 800 167 | 0,26 | 3 436 000 | EDP SERVICIOS 4,125% 23-04/04/2029 | EUR | 3 574 510 | 0,33 |
| 1 117 000 | EDP FINANCE BV 3,875% 22-11/03/2030 | EUR | 1 155 822 | 0,11 | 2 000 000 | IBERDROLA FIN SA 3,625% 23-13/07/2033 | EUR | 2 070 552 | 0,19 |
| 1 000 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4,500% 23-20/02/2043 | EUR | 1 029 364 | 0,10 | 5 000 000 | MADRILENA RED FI 1,375% 17-11/04/2025 | EUR | 4 818 707 | 0,45 |
| 3 000 000 | HEIMSTADEN BOST 0,625% 22-24/07/2025 | EUR | 2 654 367 | 0,25 | 5 000 000 | MERLIN PROPERTIES 1,375% 21-01/06/2030 | EUR | 4 232 425 | 0,39 |
| 1 500 000 | HEINEKEN NV 1,500% 17-03/10/2029 | EUR | 1 384 441 | 0,13 | 2 000 000 | TELEFONICA EMIS 1,201% 20-21/08/2027 | EUR | 1 866 411 | 0,17 |
| 3 008 000 | HEINEKEN NV 3,625% 23-15/11/2026 | EUR | 3 054 579 | 0,28 | 4 000 000 | TELEFONICA EMIS 2,318% 17-17/10/2028 | EUR | 3 854 288 | 0,36 |
| 2 395 000 | HM FINANCE 4,875% 23-25/10/2031 | EUR | 2 556 258 | 0,24 | 2 700 000 | TELEFONICA EMIS 4,183% 23-21/11/2033 | EUR | 2 834 306 | 0,26 |
| 3 726 000 | JDE PEETS NV 4,125% 23-23/01/2030 | EUR | 3 829 314 | 0,36 | | Allemagne | | 54 256 858 | 5,05 |
| 2 000 000 | KONINKLIJKE KPN 1,125% 16-11/09/2028 | EUR | 1 842 156 | 0,17 | 4 000 000 | ALBEMARLE NH 1,625% 19-25/11/2028 | EUR | 3 646 060 | 0,34 |
| 5 900 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 0,250% 19-02/08/2027 | EUR | 5 341 190 | 0,50 | 3 000 000 | AMPRION GMBH 3,450% 22-22/09/2027 | EUR | 3 030 875 | 0,28 |
| 4 550 000 | ROCHE FINANCE EU 3,312% 23-04/12/2027 | EUR | 4 654 442 | 0,43 | 4 500 000 | BASF SE 0,750% 22-17/03/2026 | EUR | 4 271 618 | 0,40 |
| 2 572 000 | ROCHE FINANCE EU 3,586% 23-04/12/2036 | EUR | 2 719 276 | 0,25 | 6 000 000 | E.ON SE 2,875% 22-26/08/2028 | EUR | 5 970 866 | 0,56 |
| 1 996 000 | SANDOZ FINANCE 3,970% 23-17/04/2027 | EUR | 2 035 163 | 0,19 | 6 177 000 | E.ON SE 3,750% 23-01/03/2029 | EUR | 6 385 123 | 0,59 |
| 2 101 000 | SANDOZ FINANCE 4,220% 23-17/04/2030 | EUR | 2 176 526 | 0,20 | 1 000 000 | EUROGRID GMBH 3,279% 22-05/09/2031 | EUR | 993 877 | 0,09 |
| 2 000 000 | SARTORIUS FIN 4,500% 23-14/09/2032 | EUR | 2 082 525 | 0,19 | 3 351 000 | FRESENIUS SE & C 5,125% 23-05/10/2030 | EUR | 3 605 246 | 0,34 |
| 1 500 000 | STELLANTIS NV 4,250% 23-16/06/2031 | EUR | 1 554 785 | 0,14 | 4 600 000 | INFINEON TECH 1,125% 20-24/06/2026 | EUR | 4 374 019 | 0,41 |
| 2 288 000 | UNIVERSAL MUSIC 4,000% 23-13/06/2031 | EUR | 2 389 577 | 0,22 | 2 000 000 | MERCK FIN SERVIC 2,375% 22-15/06/2030 | EUR | 1 933 409 | 0,18 |
| 3 000 000 | UPJOHN FINANCE 1,362% 20-23/06/2027 | EUR | 2 780 889 | 0,26 | 6 000 000 | ROBERT BOSCH 3,625% 23-02/06/2027 | EUR | 6 124 248 | 0,57 |
| 2 200 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,875% 23-29/03/2026 | EUR | 2 214 169 | 0,21 | 500 000 | ROBERT BOSCH 4,375% 23-02/06/2043 | EUR | 535 147 | 0,05 |
| 4 400 000 | VONOVIA BV 2,125% 18-22/03/2030 | EUR | 3 932 230 | 0,37 | 2 000 000 | VIER GAS TRANSPO 4,000% 22-26/09/2027 | EUR | 2 054 746 | 0,19 |
| | Royaume-Uni | | 64 707 355 | 6,02 | 8 000 000 | VOLKSWAGEN BANK 4,625% 23-03/05/2031 | EUR | 8 378 540 | 0,78 |
| 5 000 000 | ASTRAZENECA PLC 1,250% 16-12/05/2028 | EUR | 4 700 551 | 0,44 | 3 200 000 | VONOVIA SE 1,875% 22-28/06/2028 | EUR | 2 953 084 | 0,27 |
| 5 771 000 | ASTRAZENECA PLC 3,750% 23-03/03/2032 | EUR | 6 066 561 | 0,56 | | Italie | | 47 504 942 | 4,43 |
| 5 000 000 | BARCLAYS PLC 4,918% 23-08/08/2030 | EUR | 5 204 454 | 0,48 | 1 000 000 | ASSICURAZIONI 2,429% 20-14/07/2031 | EUR | 869 385 | 0,08 |
| 1 000 000 | BRITISH SKY BROADCASTING 2,500% 14-15/09/2026 | EUR | 984 829 | 0,09 | 1 055 000 | ASSICURAZIONI 5,272% 23-12/09/2033 | EUR | 1 110 904 | 0,10 |
| 5 838 000 | BRITISH TELECOMM 1,500% 17-23/06/2027 | EUR | 5 517 770 | 0,51 | 2 759 000 | AUTOSTRADA PER L 5,125% 23-14/06/2033 | EUR | 2 883 255 | 0,27 |
| 3 000 000 | BRITISH TELECOMM 2,750% 22-30/08/2027 | EUR | 2 962 840 | 0,28 | 4 865 000 | BANCO BPM SPA 4,625% 23-29/11/2027 | EUR | 5 009 410 | 0,47 |
| 5 000 000 | DIAGEO FIN PLC 1,875% 20-27/03/2027 | EUR | 4 836 011 | 0,45 | 3 558 000 | ENI SPA 3,625% 23-19/05/2027 | EUR | 3 609 869 | 0,34 |
| 2 400 000 | INTERNATIONAL CONSOLIDAT 3,750% 21-25/03/2029 | EUR | 2 322 024 | 0,22 | 4 238 000 | INTESA SANPAOLO 4,375% 23-29/08/2027 | EUR | 4 345 784 | 0,40 |
| 2 000 000 | LINDE PLC 3,375% 23-12/06/2029 | EUR | 2 053 544 | 0,19 | 10 000 000 | INTESA SANPAOLO 5,125% 23-29/08/2031 | EUR | 10 647 929 | 0,99 |
| 3 011 000 | NATIONAL GRID PLC 3,875% 23-16/01/2029 | EUR | 3 092 259 | 0,29 | 5 000 000 | SNAM 0,750% 20-17/06/2030 | EUR | 4 246 053 | 0,40 |
| 2 906 000 | NATIONAL GRID PLC 4,275% 23-16/01/2035 | EUR | 3 001 802 | 0,28 | 5 000 000 | SNAM 3,375% 22-05/12/2026 | EUR | 5 036 376 | 0,47 |
| 3 124 000 | NATWEST MARKETS 1,375% 22-02/03/2027 | EUR | 2 938 699 | 0,27 | 4 385 000 | SNAM 4,000% 23-27/11/2029 | EUR | 4 515 226 | 0,42 |
| 7 889 000 | RECKITT BEN TREASURY 3,625% 23-14/09/2028 | EUR | 8 154 944 | 0,76 | 2 520 000 | TERNA RETE 3,625% 23-21/04/2029 | EUR | 2 570 471 | 0,24 |
| 5 069 000 | SMITH & NEPHEW 4,565% 22-11/10/2029 | EUR | 5 370 688 | 0,50 | 2 582 000 | TERNA RETE 3,875% 23-24/07/2033 | EUR | 2 660 280 | 0,25 |
| 3 000 000 | TESCO CORP TREAS 0,875% 19-29/05/2026 | EUR | 2 837 421 | 0,26 | | Luxembourg | | 41 668 214 | 3,88 |
| 1 000 000 | TESCO CORP TREAS 4,250% 23-27/02/2031 | EUR | 1 038 324 | 0,10 | 4 000 000 | AROUNDTOWN SA 0,375% 21-15/04/2027 | EUR | 3 203 732 | 0,30 |
| 4 000 000 | VODAFONE GROUP 1,625% 19-24/11/2030 | EUR | 3 624 634 | 0,34 | 6 000 000 | DH EUROPE 0,450% 19-18/03/2028 | EUR | 5 416 495 | 0,50 |
| | Espagne | | 57 049 367 | 5,30 | 2 000 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 4,000% 22-06/07/2029 | EUR | 2 024 269 | 0,19 |
| 5 700 000 | ABERTIS INFRAEST 4,125% 23-07/08/2029 | EUR | 5 846 112 | 0,54 | 2 000 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 4,750% 23-06/09/2030 | EUR | 2 104 721 | 0,20 |
| 3 000 000 | ABERTIS INFRAEST 4,125% 23-31/01/2028 | EUR | 3 083 271 | 0,29 | 2 500 000 | GRAND CITY PROPERTIES 1,375% 17-03/08/2026 | EUR | 2 298 388 | 0,21 |
| 2 000 000 | ARVAL SERVICE 4,750% 22-22/05/2027 | EUR | 2 073 718 | 0,19 | 2 609 000 | HEIDELBERG MATR 4,875% 23-21/11/2033 | EUR | 2 778 502 | 0,26 |
| 5 500 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 3,375% 22-20/09/2027 | EUR | 5 547 678 | 0,52 | 4 000 000 | MEDTRONIC GLOBAL 1,125% 19-07/03/2027 | EUR | 3 778 572 | 0,35 |
| 1 700 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 4,375% 22-14/10/2029 | EUR | 1 804 756 | 0,17 | 6 000 000 | MEDTRONIC GLOBAL 3,000% 22-15/10/2028 | EUR | 6 011 548 | 0,56 |
| | | | | | 3 595 000 | NESTLE FIN INTL 3,500% 23-17/01/2030 | EUR | 3 745 414 | 0,35 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| 1 795 000 | NESTLE FIN INTL 3,750% 23-14/11/2035 | EUR | 1 915 404 | 0,18 | 11 000 000 | SOCIETE GENERALE 22-06/12/2030 FRN | EUR | 11 171 521 | 1,04 |
| 3 300 000 | TRATON FIN LUX 4,500% 23-23/11/2026 | EUR | 3 369 018 | 0,31 | 2 000 000 | SOCIETE GENERALE 23-21/11/2031 FRN | EUR | 2 089 604 | 0,19 |
| 5 000 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 4,000% 23-16/09/2025 | EUR | 5 022 151 | 0,47 | 4 200 000 | SOGECAP SA 23-16/05/2044 FRN | EUR | 4 532 591 | 0,42 |
| | <i>Suède</i> | | <i>21 361 955</i> | <i>1,99</i> | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>37 649 650</i> | <i>3,51</i> |
| 2 500 000 | MOLNLYCKE HLD 1,875% 17-28/02/2025 | EUR | 2 440 853 | 0,23 | 2 000 000 | ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES 21-21/03/2082 FRN | EUR | 1 730 780 | 0,16 |
| 1 600 000 | MOLNLYCKE HLD 4,250% 23-08/09/2028 | EUR | 1 640 311 | 0,15 | 13 600 000 | COOPERATIVE RAB 23-25/04/2029 FRN | EUR | 13 989 136 | 1,30 |
| 2 025 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 4,375% 23-06/11/2028 | EUR | 2 099 031 | 0,20 | 2 500 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 2 117 881 | 0,20 |
| 5 964 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 3,875% 23-10/05/2027 | EUR | 6 084 056 | 0,57 | 4 000 000 | ING GROEP NV 23/05/2029 FRN | EUR | 4 120 150 | 0,38 |
| 4 000 000 | SWEDEBANK AB 4,250% 23-11/07/2028 | EUR | 4 107 907 | 0,38 | 5 000 000 | NATURGY FINANCE 21-23/02/2170 FRN | EUR | 4 550 432 | 0,42 |
| 4 900 000 | VOLVO TREAS AB 3,875% 23-29/08/2026 | EUR | 4 989 797 | 0,46 | 2 000 000 | NN GROUP NV 23-03/11/2043 FRN | EUR | 2 130 190 | 0,20 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>9 677 501</i> | <i>0,90</i> | 2 000 000 | TELEFONICA EUROP 23-07/09/2172 FRN | EUR | 2 131 440 | 0,20 |
| 1 807 000 | CARLSBERG BREW 3,500% 23-26/11/2026 | EUR | 1 828 368 | 0,17 | 1 500 000 | VOLKSWAGEN INTFN 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 456 870 | 0,14 |
| 1 886 000 | CARLSBERG BREW 4,000% 23-05/10/2028 | EUR | 1 953 223 | 0,18 | 1 000 000 | VOLKSWAGEN INTFN 20-31/12/2060 FRN | EUR | 914 575 | 0,09 |
| 1 141 000 | CARLSBERG BREW 4,250% 23-05/10/2033 | EUR | 1 213 158 | 0,11 | 2 500 000 | VOLKSWAGEN INTFN 22-28/12/2170 FRN | EUR | 2 338 394 | 0,22 |
| 4 530 000 | NYKREDIT 4,625% 23-19/01/2029 | EUR | 4 682 752 | 0,44 | 2 000 000 | VOLKSWAGEN INTFN 23-06/09/2172 FRN | EUR | 2 169 802 | 0,20 |
| | <i>Japon</i> | | <i>9 366 104</i> | <i>0,88</i> | | <i>Espagne</i> | | <i>34 152 445</i> | <i>3,17</i> |
| 2 500 000 | ASAHI GROUP 0,541% 20-23/10/2028 | EUR | 2 205 336 | 0,21 | 7 000 000 | BANCO SABADELL 23-07/02/2029 FRN | EUR | 7 224 957 | 0,67 |
| 3 000 000 | NTT FINANCE 0,399% 21-13/12/2028 | EUR | 2 662 005 | 0,25 | 5 000 000 | BANCO SABADELL 23-08/09/2029 FRN | EUR | 5 196 432 | 0,48 |
| 4 607 000 | TAKEDA PHARM 2,250% 18-21/11/2026 | EUR | 4 498 763 | 0,42 | 3 200 000 | BANCO SABADELL 23-16/08/2033 FRN | EUR | 3 235 500 | 0,30 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>7 646 062</i> | <i>0,71</i> | 4 000 000 | BANCO SANTANDER 23-18/10/2027 FRN | EUR | 4 097 028 | 0,38 |
| 6 500 000 | RYANAIR DAC 0,875% 21-25/05/2026 | EUR | 6 129 884 | 0,57 | 1 300 000 | BANCO SANTANDER 23-23/08/2033 FRN | EUR | 1 361 687 | 0,13 |
| 1 500 000 | VODAFONE INT FIN 4,000% 23-10/02/2043 | EUR | 1 516 178 | 0,14 | 2 000 000 | BANKINTER SA 23-13/09/2031 FRN | EUR | 2 094 106 | 0,19 |
| | <i>Canada</i> | | <i>6 956 401</i> | <i>0,65</i> | 1 000 000 | CAIXABANK 22-23/02/2033 FRN | EUR | 1 056 287 | 0,10 |
| 1 400 000 | MERCEDES-BENZ CA FIN 3,000% 22-23/02/2027 | EUR | 1 400 936 | 0,13 | 2 000 000 | CAIXABANK 23-19/07/2029 FRN | EUR | 2 090 355 | 0,19 |
| 3 532 000 | ROYAL BANK OF CANADA 4,125% 23-05/07/2028 | EUR | 3 643 285 | 0,34 | 2 500 000 | CAIXABANK 23-30/05/2034 FRN | EUR | 2 641 329 | 0,25 |
| 2 000 000 | TOTAL CAP CANADA 2,125% 14-18/09/2029 | EUR | 1 912 180 | 0,18 | 5 800 000 | IBERDROLA FIN SA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 5 154 764 | 0,48 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>4 596 144</i> | <i>0,43</i> | | <i>Italie</i> | | <i>23 809 779</i> | <i>2,21</i> |
| 1 774 000 | AB INBEV SA/NV 1,125% 19-01/07/2027 | EUR | 1 673 375 | 0,16 | 2 584 000 | BANCO BPM SPA 23-14/06/2028 FRN | EUR | 2 703 784 | 0,25 |
| 3 190 000 | AB INBEV SA/NV 1,650% 19-28/03/2031 | EUR | 2 922 769 | 0,27 | 3 906 000 | CREDITO EMILIANO 23-26/03/2030 FRN | EUR | 4 028 087 | 0,37 |
| | <i>Mexique</i> | | <i>4 173 395</i> | <i>0,39</i> | 9 500 000 | ENEL SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 8 281 391 | 0,77 |
| 3 500 000 | AMERICA MOVIL SA 0,750% 19-26/06/2027 | EUR | 3 218 565 | 0,30 | 3 015 000 | MEDIOBANCA SPA 23-01/02/2030 FRN | EUR | 3 102 454 | 0,29 |
| 1 000 000 | AMERICA MOVIL SA 2,125% 16-10/03/2028 | EUR | 954 830 | 0,09 | 5 460 000 | UNICREDIT SPA 23-14/02/2030 FRN | EUR | 5 694 063 | 0,53 |
| | <i>Finlande</i> | | <i>2 716 588</i> | <i>0,25</i> | | <i>Allemagne</i> | | <i>23 220 754</i> | <i>2,16</i> |
| 2 633 000 | NORDEA BANK ABP 4,125% 23-05/05/2028 | EUR | 2 716 588 | 0,25 | 5 500 000 | BERTELSMANN SE 15-23/04/2075 FRN | EUR | 5 234 286 | 0,49 |
| | Obligations à taux flottant | | 271 948 424 | 25,31 | 4 200 000 | COMMERZBANK AG 22-14/09/2027 FRN | EUR | 4 110 103 | 0,38 |
| | <i>France</i> | | <i>41 362 993</i> | <i>3,85</i> | 3 000 000 | COMMERZBANK AG 23-05/10/2033 FRN | EUR | 3 195 460 | 0,30 |
| 2 000 000 | ACCOR 23-11/04/2172 FRN | EUR | 2 169 646 | 0,20 | 2 400 000 | COMMERZBANK AG 23-25/03/2029 FRN | EUR | 2 519 271 | 0,23 |
| 1 000 000 | AXA SA 23-11/07/2043 FRN | EUR | 1 069 568 | 0,10 | 3 300 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-05/09/2030 FRN | EUR | 3 405 240 | 0,32 |
| 5 000 000 | BNP PARIBAS 21-30/05/2028 FRN | EUR | 4 524 058 | 0,42 | 2 000 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-23/02/2028 FRN | EUR | 1 878 874 | 0,17 |
| 5 000 000 | BNP PARIBAS 22-11/07/2030 FRN | EUR | 4 307 107 | 0,40 | 3 000 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-24/06/2032 FRN | EUR | 2 877 520 | 0,27 |
| 3 000 000 | BNP PARIBAS 23-13/11/2032 FRN | EUR | 3 180 560 | 0,30 | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>14 899 684</i> | <i>1,39</i> |
| 1 300 000 | BNP PARIBAS 23-26/09/2032 FRN | EUR | 1 360 589 | 0,13 | 2 500 000 | BANK OF AMERICA CORP 20-26/10/2031 FRN | EUR | 2 047 433 | 0,19 |
| 600 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 14-31/10/2049 FRN | EUR | 596 177 | 0,06 | 2 000 000 | JPMORGAN CHASE 17-18/05/2028 FRN | EUR | 1 888 299 | 0,18 |
| 1 500 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 16-27/09/2048 FRN | EUR | 1 511 722 | 0,14 | 2 500 000 | JPMORGAN CHASE 23-13/11/2031 FRN | EUR | 2 635 039 | 0,25 |
| 2 000 000 | ENGIE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 752 849 | 0,16 | 3 000 000 | MORGAN STANLEY 22-25/10/2028 FRN | EUR | 3 138 917 | 0,29 |
| 2 200 000 | MUTUELLE ASSUR 21-21/06/2052 FRN | EUR | 1 690 640 | 0,16 | 5 000 000 | MORGAN STANLEY 23-02/03/2029 FRN | EUR | 5 189 996 | 0,48 |
| 1 500 000 | SOCIETE GENERALE 20-24/11/2030 FRN | EUR | 1 406 361 | 0,13 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|---|--------------------|----------------------|-------------------|
| | <i>Suisse</i> | | <i>14 155 675</i> | <i>1,32</i> |
| 5 593 000 | CREDIT SUISSE 22-01/03/2029 FRN | EUR | 6 440 534 | 0,60 |
| 5 518 000 | UBS GROUP 22-15/06/2027 FRN | EUR | 5 400 104 | 0,50 |
| 2 200 000 | UBS GROUP 23-17/03/2032 FRN | EUR | 2 315 037 | 0,22 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>13 894 209</i> | <i>1,29</i> |
| 2 942 000 | AIB GROUP PLC 22-16/02/2029 FRN | EUR | 3 160 563 | 0,29 |
| 2 000 000 | AIB GROUP PLC 23-23/10/2031 FRN | EUR | 2 159 255 | 0,20 |
| 1 000 000 | BANK OF IRELAND 22-01/03/2033 FRN | EUR | 1 079 726 | 0,10 |
| 7 216 000 | BANK OF IRELAND 23-13/11/2029 FRN | EUR | 7 494 665 | 0,70 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>12 596 636</i> | <i>1,18</i> |
| 8 179 000 | DANSKE BANK A/S 23-09/11/2028 FRN | EUR | 8 436 416 | 0,79 |
| 4 000 000 | JYSKE BANK A/S 23-10/11/2029 FRN | EUR | 4 160 220 | 0,39 |
| | <i>Norvège</i> | | <i>12 272 935</i> | <i>1,14</i> |
| 6 038 000 | DNB BANK ASA 23-01/11/2029 FRN | EUR | 6 343 230 | 0,59 |
| 5 739 000 | DNB BANK ASA 23-19/07/2028 FRN | EUR | 5 929 705 | 0,55 |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>11 249 567</i> | <i>1,05</i> |
| 5 500 000 | BARCLAYS BANK PLC 21-22/03/2031 FRN | EUR | 5 066 119 | 0,47 |
| 2 000 000 | HSBC HOLDINGS 23/05/2033 FRN | EUR | 2 119 322 | 0,20 |
| 3 000 000 | HSBC HOLDINGS 23-10/03/2032 FRN | EUR | 3 170 898 | 0,30 |
| 1 000 000 | VODAFONE GROUP 20-27/08/2080 FRN | EUR | 893 228 | 0,08 |
| | <i>Portugal</i> | | <i>9 034 851</i> | <i>0,84</i> |
| 4 000 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 21-07/04/2028 FRN | EUR | 3 732 606 | 0,35 |
| 2 300 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 23-02/10/2026 FRN | EUR | 2 361 930 | 0,22 |
| 3 500 000 | EDP SA 21-14/03/2082 FRN | EUR | 2 940 315 | 0,27 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>8 090 252</i> | <i>0,75</i> |
| 3 300 000 | KBC GROUP NV 19-03/12/2029 FRN | EUR | 3 161 649 | 0,29 |
| 4 800 000 | KBC GROUP NV 23-28/11/2029 FRN | EUR | 4 928 603 | 0,46 |
| | <i>Grèce</i> | | <i>6 042 550</i> | <i>0,56</i> |
| 5 764 000 | PIRAEUS BANK 23-05/12/2029 FRN | EUR | 6 042 550 | 0,56 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>4 043 934</i> | <i>0,38</i> |
| 3 900 000 | ERSTE GROUP 23-30/05/2030 FRN | EUR | 4 043 934 | 0,38 |
| | <i>Finlande</i> | | <i>3 483 270</i> | <i>0,32</i> |
| 3 440 000 | NORDEA BANK ABP 23-06/09/2026 FRN | EUR | 3 483 270 | 0,32 |
| | <i>Suède</i> | | <i>1 989 240</i> | <i>0,19</i> |
| 2 000 000 | TELIA CO AB 22-21/12/2082 FRN | EUR | 1 989 240 | 0,19 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 57 933 344 | 5,39 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>57 933 344</i> | <i>5,39</i> |
| 5 000,00 | BNP PARIBAS FLEXI I ABS EUROPE AAA - X CAP | EUR | 5 324 850 | 0,50 |
| 70,00 | BNP PARIBAS FUNDS EURO CORPORATE GREEN BOND - X CAP | EUR | 7 697 905 | 0,72 |
| 317 009,59 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - I CAP | EUR | 44 910 589 | 4,17 |
| | Total portefeuille-titres | | 1 032 630 454 | 96,13 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|-----------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 67 301 509 | 65,61 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 600 000 | AIR FRANCE-KLM 7,250% 23-31/05/2026 | EUR | 639 261 | 0,62 | 400 000 | JCDECAUX SE 5,000% 23-11/01/2029 | EUR | 420 106 | 0,41 |
| 500 000 | AIR FRANCE-KLM 8,125% 23-31/05/2028 | EUR | 566 542 | 0,55 | 200 000 | KERING 3,625% 23-05/09/2031 | EUR | 206 661 | 0,20 |
| 400 000 | ALD SA 4,000% 22-05/07/2027 | EUR | 407 894 | 0,40 | 200 000 | KERING 3,875% 23-05/09/2035 | EUR | 209 481 | 0,20 |
| 300 000 | ATOS SE 1,000% 21-12/11/2029 | EUR | 160 317 | 0,16 | 100 000 | KLEPIERRE 1,250% 16-29/09/2031 | EUR | 84 321 | 0,08 |
| 100 000 | AXA SA 3,625% 23-10/01/2033 | EUR | 105 690 | 0,10 | 500 000 | LA POSTE SA 1,375% 20-21/04/2032 | EUR | 433 202 | 0,42 |
| 100 000 | AXA SA 3,750% 22-12/10/2030 | EUR | 105 384 | 0,10 | 400 000 | LOREAL SA 3,375% 23-23/01/2027 | EUR | 406 460 | 0,40 |
| 200 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,625% 20-21/02/2031 | EUR | 163 336 | 0,16 | 400 000 | LOREAL SA 3,375% 23-23/11/2029 | EUR | 412 142 | 0,40 |
| 500 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,625% 21-03/11/2028 | EUR | 436 994 | 0,43 | 400 000 | LVMH MOET HENNESSY 3,500% 23-07/09/2033 | EUR | 412 934 | 0,40 |
| 400 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,125% 23-13/03/2029 | EUR | 414 785 | 0,40 | 600 000 | ORANO SA 5,375% 22-15/05/2027 | EUR | 627 105 | 0,61 |
| 300 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,375% 23-02/05/2030 | EUR | 311 506 | 0,30 | 400 000 | PERNOD RICARD SA 3,750% 23-15/09/2033 | EUR | 416 591 | 0,41 |
| 200 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,750% 23-10/11/2031 | EUR | 212 041 | 0,21 | 200 000 | PSA BANQUE FRANC 3,875% 23-19/01/2026 | EUR | 201 330 | 0,20 |
| 300 000 | BOUYGUES SA 3,875% 23-17/07/2031 | EUR | 312 650 | 0,31 | 450 000 | RCI BANQUE 1,625% 18-26/05/2026 | EUR | 429 879 | 0,42 |
| 200 000 | BPCE 3,625% 23-17/04/2026 | EUR | 201 615 | 0,20 | 356 000 | RCI BANQUE 4,125% 22-01/12/2025 | EUR | 358 324 | 0,35 |
| 200 000 | BPCE 4,125% 23-10/07/2028 | EUR | 207 307 | 0,20 | 355 000 | RCI BANQUE 4,750% 22-06/07/2027 | EUR | 370 185 | 0,36 |
| 400 000 | BPCE 4,375% 23-13/07/2028 | EUR | 413 131 | 0,40 | 150 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-14/06/2028 | EUR | 157 660 | 0,15 |
| 300 000 | CAISSE NATIONALE REASSURANCE MUTUELLE 2,125% 19-16/09/2029 | EUR | 273 614 | 0,27 | 400 000 | SOCIETE GENERALE 4,125% 23-02/06/2027 | EUR | 410 080 | 0,40 |
| 300 000 | CARMILA SA 1,625% 20-30/05/2027 | EUR | 276 645 | 0,27 | 300 000 | SOCIETE GENERALE 4,250% 23-28/09/2026 | EUR | 307 355 | 0,30 |
| 300 000 | CARMILA SA 5,500% 23-09/10/2028 | EUR | 311 069 | 0,30 | 100 000 | SUEZ 4,500% 23-13/11/2033 | EUR | 106 641 | 0,10 |
| 400 000 | CARREFOUR BANQUE 4,079% 23-05/05/2027 | EUR | 405 806 | 0,40 | 100 000 | TELEPERFORMANCE 5,250% 23-22/11/2028 | EUR | 104 508 | 0,10 |
| 400 000 | CARREFOUR SA 1,875% 22-30/10/2026 | EUR | 386 113 | 0,38 | 100 000 | TEREOS FIN GROUP 4,750% 22-30/04/2027 | EUR | 100 484 | 0,10 |
| 400 000 | CARREFOUR SA 3,750% 23-10/10/2030 | EUR | 407 807 | 0,40 | 400 000 | THALES SA 3,625% 23-14/06/2029 | EUR | 408 473 | 0,40 |
| 200 000 | CARREFOUR SA 4,375% 23-14/11/2031 | EUR | 211 922 | 0,21 | 300 000 | URW 0,625% 20-04/05/2027 | EUR | 274 310 | 0,27 |
| 300 000 | CIE DE ST GOBAIN 3,500% 23-18/01/2029 | EUR | 306 111 | 0,30 | 400 000 | URW 0,750% 21-25/10/2028 | EUR | 358 225 | 0,35 |
| 300 000 | CIE DE ST GOBAIN 3,750% 23-29/11/2026 | EUR | 304 895 | 0,30 | 200 000 | URW 4,125% 23-11/12/2030 | EUR | 205 825 | 0,20 |
| 300 000 | CIE DE ST GOBAIN 3,875% 23-29/11/2030 | EUR | 310 238 | 0,30 | 300 000 | VALEO SE 5,875% 23-12/04/2029 | EUR | 321 680 | 0,31 |
| 200 000 | COVIVIO 4,625% 23-05/06/2032 | EUR | 207 347 | 0,20 | 300 000 | VERALLIA SA 1,875% 21-10/11/2031 | EUR | 263 575 | 0,26 |
| 200 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 1,500% 21-06/10/2031 | EUR | 163 291 | 0,16 | 210 000 | WPP FINANCE 4,125% 23-30/05/2028 | EUR | 216 477 | 0,21 |
| 100 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 2,000% 20-17/07/2030 | EUR | 87 553 | 0,09 | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 400 000 | CREDIT AGRICOLE SA 3,375% 22-28/07/2027 | EUR | 402 551 | 0,39 | 300 000 | ABN AMRO BANK NV 3,875% 23-21/12/2026 | EUR | 306 012 | 0,30 |
| 300 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 3,875% 23-22/05/2028 | EUR | 306 354 | 0,30 | 400 000 | ABN AMRO BANK NV 4,000% 23-16/01/2028 | EUR | 409 906 | 0,40 |
| 400 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 4,125% 23-02/04/2031 | EUR | 418 909 | 0,41 | 400 000 | ALLIANZ FINANCE 1,500% 19-15/01/2030 | EUR | 373 323 | 0,36 |
| 200 000 | DANONE 3,706% 23-13/11/2029 | EUR | 208 367 | 0,20 | 100 000 | ASR NEDERLAND NV 3,625% 23-12/12/2028 | EUR | 101 310 | 0,10 |
| 400 000 | EDENRED 3,625% 23-13/06/2031 | EUR | 406 765 | 0,40 | 269 000 | BMW FINANCE NV 4,125% 23-04/10/2033 | EUR | 289 735 | 0,28 |
| 400 000 | EDENRED 3,625% 23-13/12/2026 | EUR | 405 219 | 0,40 | 375 000 | COMPASS GROUP 3,000% 22-08/03/2030 | EUR | 373 481 | 0,36 |
| 200 000 | ELEC DE FRANCE 3,750% 23-05/06/2027 | EUR | 203 853 | 0,20 | 410 000 | EASYJET FINCO 1,875% 21-03/03/2028 | EUR | 382 690 | 0,37 |
| 400 000 | ELO SACA 6,000% 23-22/03/2029 | EUR | 405 488 | 0,40 | 236 000 | ENBW 4,300% 23-23/05/2034 | EUR | 249 217 | 0,24 |
| 100 000 | ENGIE 2,000% 17-28/09/2037 | EUR | 83 030 | 0,08 | 473 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4,000% 23-20/02/2031 | EUR | 488 666 | 0,48 |
| 200 000 | ENGIE 3,750% 23-06/09/2027 | EUR | 204 022 | 0,20 | 122 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4,500% 23-20/02/2043 | EUR | 125 582 | 0,12 |
| 200 000 | ENGIE 3,875% 23-06/01/2031 | EUR | 206 778 | 0,20 | 471 000 | HEIMSTADEN BOST 0,250% 21-13/10/2024 | EUR | 443 021 | 0,43 |
| 200 000 | ENGIE 4,250% 23-06/09/2034 | EUR | 211 857 | 0,21 | 150 000 | HEINEKEN NV 3,625% 23-15/11/2026 | EUR | 152 323 | 0,15 |
| 100 000 | ENGIE 4,250% 23-11/01/2043 | EUR | 104 577 | 0,10 | 205 000 | HM FINANCE 4,875% 23-25/10/2031 | EUR | 218 803 | 0,21 |
| 100 000 | ENGIE 4,500% 23-06/09/2042 | EUR | 107 660 | 0,11 | 300 000 | KONINKLIJKE KPN 3,875% 23-03/07/2031 | EUR | 310 804 | 0,30 |
| 100 000 | FAURECIA 2,750% 21-15/02/2027 | EUR | 95 441 | 0,09 | 184 000 | RELX FINANCE 3,750% 23-12/06/2031 | EUR | 191 165 | 0,19 |
| 100 000 | GDF SUEZ 1,500% 15-13/03/2035 | EUR | 81 296 | 0,08 | 192 000 | SANDOZ FINANCE 3,970% 23-17/04/2027 | EUR | 195 767 | 0,19 |
| 400 000 | HOLDING DINFRA 2,500% 20-04/05/2027 | EUR | 387 770 | 0,38 | 168 000 | SANDOZ FINANCE 4,220% 23-17/04/2030 | EUR | 174 039 | 0,17 |
| 300 000 | ICADE 0,625% 21-18/01/2031 | EUR | 236 301 | 0,23 | 150 000 | SANDOZ FINANCE 4,500% 23-17/11/2033 | EUR | 158 972 | 0,16 |
| 400 000 | ICADE 1,000% 22-19/01/2030 | EUR | 339 251 | 0,33 | 300 000 | SHELL INTERNATIONAL FIN 0,875% 19-08/11/2039 | EUR | 206 669 | 0,20 |
| 200 000 | ICADE 1,625% 18-28/02/2028 | EUR | 185 724 | 0,18 | 100 000 | SIEMENS FINAN 3,625% 23-24/02/2043 | EUR | 103 851 | 0,10 |
| | | | | | 212 000 | SIKA CAPITAL BV 3,750% 23-03/05/2030 | EUR | 218 220 | 0,21 |
| | | | | | 472 000 | SIKA CAPITAL BV 3,750% 23-03/11/2026 | EUR | 479 746 | 0,47 |
| | | | | | 267 000 | UNIVERSAL MUSIC 4,000% 23-13/06/2031 | EUR | 278 854 | 0,27 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | |
|--------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------|--|---|---------------------|-------------------|------|
| 400 000 | VOLKSWAGEN INTFN 1,875% 17-30/03/2027 | EUR | 381 998 | 0,37 | 400 000 | NATWEST MARKETS 0,125% 21-18/06/2026 | EUR | 370 459 | 0,36 | |
| 400 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,750% 22-28/09/2027 | EUR | 405 393 | 0,40 | 271 000 | SAGE GROUP 3,820% 23-15/02/2028 | EUR | 278 478 | 0,27 | |
| 300 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,875% 23-29/03/2026 | EUR | 301 932 | 0,29 | 401 000 | TESCO CORP TREAS 4,250% 23-27/02/2031 | EUR | 416 368 | 0,41 | |
| 300 000 | VOLKSWAGEN INTFN 4,250% 23-29/03/2029 | EUR | 311 339 | 0,30 | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | |
| 500 000 | VONOVIA BV 1,500% 18-22/03/2026 | EUR | 477 601 | 0,47 | 308 000 | AT&T INC 3,950% 23-30/04/2031 | EUR | 319 283 | 0,31 | |
| 300 000 | ZF EUROPE FIN BV 6,125% 23-13/03/2029 | EUR | 318 243 | 0,31 | 283 000 | AT&T INC 4,300% 23-18/11/2034 | EUR | 298 737 | 0,29 | |
| <i>Allemagne</i> | | | | 6 443 659 | 6,28 | 369 000 | BANK OF AMERICA CORP 4,134% 23-12/06/2028 | EUR | 380 290 | 0,37 |
| 214 000 | BAYER AG 4,250% 23-26/08/2029 | EUR | 221 287 | 0,22 | 169 000 | BOOKING HLDS INC 3,625% 23-12/11/2028 | EUR | 173 607 | 0,17 | |
| 269 000 | BAYER AG 4,625% 23-26/05/2033 | EUR | 280 012 | 0,27 | 200 000 | BOOKING HLDS INC 4,250% 22-15/05/2029 | EUR | 211 626 | 0,21 | |
| 200 000 | BERTELSMANN SE 3,500% 22-29/05/2029 | EUR | 202 465 | 0,20 | 182 000 | BOOKING HLDS INC 4,500% 22-15/11/2031 | EUR | 198 098 | 0,19 | |
| 360 000 | CONTINENTAL AG 4,000% 23-01/06/2028 | EUR | 371 477 | 0,36 | 136 000 | CARRIER GLOBAL 4,125% 23-29/05/2028 | EUR | 139 873 | 0,14 | |
| 300 000 | COVESTRO AG 4,750% 22-15/11/2028 | EUR | 319 276 | 0,31 | 100 000 | ELI LILLY & CO 1,700% 19-01/11/2049 | EUR | 75 228 | 0,07 | |
| 700 000 | DEUTSCHE BANK AG 1,625% 20-20/01/2027 | EUR | 656 986 | 0,65 | 250 000 | FORD MOTOR CREDIT 5,125% 23-20/02/2029 | EUR | 261 356 | 0,25 | |
| 200 000 | DEUTSCHE BANK AG 4,000% 22-29/11/2027 | EUR | 205 478 | 0,20 | 492 000 | IBM CORP 3,625% 23-06/02/2031 | EUR | 507 052 | 0,49 | |
| 400 000 | DT LUFTHANSA AG 3,750% 21-11/02/2028 | EUR | 393 144 | 0,38 | 124 000 | IHG FINANCE LLC 4,375% 23-28/11/2029 | EUR | 128 433 | 0,13 | |
| 234 000 | E.ON SE 3,875% 23-12/01/2035 | EUR | 242 984 | 0,24 | 202 000 | NASDAQ INC 4,500% 23-15/02/2032 | EUR | 216 158 | 0,21 | |
| 235 000 | FRESENIUS SE & C 5,125% 23-05/10/2030 | EUR | 252 830 | 0,25 | 100 000 | PROLOGIS EURO 0,500% 21-16/02/2032 | EUR | 78 232 | 0,08 | |
| 100 000 | GRUENENTHAL GMBH 6,750% 23-15/05/2030 | EUR | 105 827 | 0,10 | 200 000 | PROLOGIS EURO 0,625% 19-10/09/2031 | EUR | 163 188 | 0,16 | |
| 300 000 | LEG IMMOBILIEN SE 0,375% 22-17/01/2026 | EUR | 280 590 | 0,27 | 100 000 | PROLOGIS EURO 1,000% 20-06/02/2035 | EUR | 74 489 | 0,07 | |
| 400 000 | LEG IMMOBILIEN SE 1,000% 21-19/11/2032 | EUR | 310 770 | 0,30 | 100 000 | PROLOGIS EURO 1,500% 19-10/09/2049 | EUR | 60 919 | 0,06 | |
| 300 000 | ROBERT BOSCH 3,625% 23-02/06/2030 | EUR | 307 964 | 0,30 | 200 000 | PROLOGIS EURO 4,625% 23-23/05/2033 | EUR | 213 289 | 0,21 | |
| 200 000 | ROBERT BOSCH 4,375% 23-02/06/2043 | EUR | 214 059 | 0,21 | 600 000 | PROLOGIS LP 3,000% 14-02/06/2026 | EUR | 591 320 | 0,58 | |
| 100 000 | VIER GAS TRANSPO 4,000% 22-26/09/2027 | EUR | 102 737 | 0,10 | 116 000 | STRYKER CORP 3,375% 23-11/12/2028 | EUR | 117 560 | 0,11 | |
| 400 000 | VOLKSWAGEN BANK 4,250% 23-07/01/2026 | EUR | 404 650 | 0,39 | 200 000 | THERMO FISHER 1,500% 19-01/10/2039 | EUR | 152 483 | 0,15 | |
| 200 000 | VOLKSWAGEN BANK 4,375% 23-03/05/2028 | EUR | 205 998 | 0,20 | 200 000 | TOYOTA MTR CREDIT 3,850% 23-24/07/2030 | EUR | 207 808 | 0,20 | |
| 200 000 | VOLKSWAGEN BANK 4,625% 23-03/05/2031 | EUR | 209 464 | 0,20 | 200 000 | TOYOTA MTR CREDIT 4,050% 23-13/09/2029 | EUR | 209 684 | 0,20 | |
| 254 000 | VOLKSWAGEN LEAS 4,625% 23-25/03/2029 | EUR | 267 554 | 0,26 | 200 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 2,875% 17-15/01/2038 | EUR | 184 146 | 0,18 | |
| 125 000 | VOLKSWAGEN LEAS 4,750% 23-25/09/2031 | EUR | 133 146 | 0,13 | <i>Italie</i> | | | | | |
| 200 000 | VONOVIA SE 1,000% 21-16/06/2033 | EUR | 151 851 | 0,15 | 300 000 | 2I RETE GAS SPA 4,375% 23-06/06/2033 | EUR | 306 780 | 0,30 | |
| 300 000 | VONOVIA SE 1,375% 22-28/01/2026 | EUR | 286 509 | 0,28 | 200 000 | A2A SPA 2,500% 22-15/06/2026 | EUR | 196 283 | 0,19 | |
| 300 000 | VONOVIA SE 5,000% 22-23/11/2030 | EUR | 316 601 | 0,31 | 200 000 | A2A SPA 4,500% 22-19/09/2030 | EUR | 210 217 | 0,21 | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | 5 857 783 | 5,72 | 200 000 | ASSICURAZIONI 1,713% 21-30/06/2032 | EUR | 160 113 | 0,16 |
| 204 000 | BARCLAYS PLC 4,918% 23-08/08/2030 | EUR | 212 342 | 0,21 | 617 000 | AUTOSTRADA TORIN 1,000% 21-25/11/2026 | EUR | 574 317 | 0,56 | |
| 558 000 | BP CAPITAL MARKETS BV 3,773% 23-12/05/2030 | EUR | 576 628 | 0,56 | 129 000 | AUTOSTRADA PER L 4,750% 23-24/01/2031 | EUR | 132 905 | 0,13 | |
| 200 000 | BP CAPITAL MARKETS BV 4,323% 23-12/05/2035 | EUR | 211 810 | 0,21 | 176 000 | AUTOSTRADA PER L 5,125% 23-14/06/2033 | EUR | 183 926 | 0,18 | |
| 380 000 | BP CAPITAL PLC 2,519% 20-07/04/2028 | EUR | 372 604 | 0,36 | 203 000 | BANCO BPM SPA 4,625% 23-29/11/2027 | EUR | 209 026 | 0,20 | |
| 400 000 | BRITISH TELECOMM 3,750% 23-13/05/2031 | EUR | 410 591 | 0,40 | 455 000 | ENI SPA 3,625% 23-19/05/2027 | EUR | 461 633 | 0,45 | |
| 250 000 | BRITISH TELECOMM 4,250% 23-06/01/2033 | EUR | 263 076 | 0,26 | 317 000 | ENI SPA 4,250% 23-19/05/2033 | EUR | 332 333 | 0,32 | |
| 307 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 315 783 | 0,31 | 610 000 | INTESA SANPAOLO 1,000% 19-19/11/2026 | EUR | 571 061 | 0,56 | |
| 280 000 | HEATHROW FNDG 4,500% 23-11/07/2033 | EUR | 297 617 | 0,29 | 200 000 | INTESA SANPAOLO 4,000% 23-19/05/2026 | EUR | 202 786 | 0,20 | |
| 600 000 | INTERNATIONAL CONSOLIDAT 3,750% 21-25/03/2029 | EUR | 580 506 | 0,57 | 200 000 | INTESA SANPAOLO 4,875% 23-19/05/2030 | EUR | 210 280 | 0,21 | |
| 279 000 | LLOYDS BANK 4,125% 23-30/05/2027 | EUR | 285 490 | 0,28 | 220 000 | INTESA SANPAOLO 5,125% 23-29/08/2031 | EUR | 234 254 | 0,23 | |
| 550 000 | NATIONAL GRID ELECT 0,823% 20-07/07/2032 | EUR | 445 648 | 0,43 | 150 000 | INTESA SANPAOLO 5,625% 23-08/03/2033 | EUR | 161 274 | 0,16 | |
| 216 000 | NATIONAL GRID PLC 3,875% 23-16/01/2029 | EUR | 221 829 | 0,22 | 219 000 | SNAM 4,000% 23-27/11/2029 | EUR | 225 504 | 0,22 | |
| 290 000 | NATIONAL GRID PLC 4,275% 23-16/01/2035 | EUR | 299 560 | 0,29 | <i>Espagne</i> | | | | | |
| 300 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 3,250% 22-05/09/2029 | EUR | 298 994 | 0,29 | 300 000 | ABERTIS INFRAEST 4,125% 23-31/01/2028 | EUR | 308 327 | 0,30 | |
| | | | | | 600 000 | ARVAL SERVICE 4,000% 22-22/09/2026 | EUR | 606 849 | 0,59 | |
| | | | | | 400 000 | ARVAL SERVICE 4,750% 22-22/05/2027 | EUR | 414 744 | 0,40 | |
| | | | | | 400 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 3,375% 22-20/09/2027 | EUR | 403 468 | 0,39 | |
| | | | | | 400 000 | BANCO SANTANDER 3,875% 23-16/01/2028 | EUR | 409 283 | 0,40 | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 200 000 | BANCO SANTANDER 4,250% 23-12/06/2030 | EUR | 208 968 | 0,20 | | <i>Suisse</i> | | 439 058 | 0,43 |
| 200 000 | BANCO SANTANDER 4,875% 23-18/10/2031 | EUR | 212 896 | 0,21 | 500 000 | UBS GROUP 0,250% 21-24/02/2028 | EUR | 439 058 | 0,43 |
| 200 000 | CAIXABANK 4,375% 23-29/11/2033 | EUR | 209 955 | 0,20 | | <i>Islande</i> | | 349 009 | 0,34 |
| 343 000 | EDP SERVICIOS 4,125% 23-04/04/2029 | EUR | 356 827 | 0,35 | 367 000 | ISLANDSBANKI 0,750% 22-25/03/2025 | EUR | 349 009 | 0,34 |
| 196 000 | EDP SERVICIOS 4,375% 23-04/04/2032 | EUR | 208 608 | 0,20 | | <i>Norvège</i> | | 298 033 | 0,29 |
| 300 000 | INMOBILIARIA COL 1,350% 20-14/10/2028 | EUR | 276 307 | 0,27 | 300 000 | SPAREBANK 1 SMN 3,125% 22-22/12/2025 | EUR | 298 033 | 0,29 |
| 300 000 | MERLIN PROPERTIES 2,375% 20-13/07/2027 | EUR | 288 562 | 0,28 | | <i>Australie</i> | | 295 472 | 0,29 |
| | <i>Luxembourg</i> | | 3 858 098 | 3,75 | 281 000 | SYDNEY AIRPORT F 4,375% 23-03/05/2033 | EUR | 295 472 | 0,29 |
| 376 000 | BECTON DICKINSON 3,553% 23-13/09/2029 | EUR | 383 437 | 0,37 | | <i>Liechtenstein</i> | | 161 940 | 0,16 |
| 500 000 | CNH INDUSTRIAL FIN 1,625% 19-03/07/2029 | EUR | 454 473 | 0,44 | 200 000 | SWISS LIFE FIN 1 0,500% 21-15/09/2031 | EUR | 161 940 | 0,16 |
| 100 000 | DH EUROPE 1,350% 19-18/09/2039 | EUR | 75 466 | 0,07 | | Obligations à taux flottant | | 30 117 824 | 29,41 |
| 370 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 4,000% 22-06/07/2029 | EUR | 374 490 | 0,37 | | <i>France</i> | | 7 742 436 | 7,56 |
| 219 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 4,750% 23-06/09/2030 | EUR | 230 467 | 0,22 | 100 000 | AXA SA 18-28/05/2049 FRN | EUR | 95 923 | 0,09 |
| 300 000 | GRAND CITY PROPERTIES 0,125% 21-11/01/2028 | EUR | 251 454 | 0,25 | 100 000 | AXA SA 21-07/10/2041 FRN | EUR | 82 456 | 0,08 |
| 400 000 | MEDTRONIC GLOBAL 1,625% 20-15/10/2050 | EUR | 271 070 | 0,26 | 100 000 | AXA SA 22-10/03/2043 FRN | EUR | 98 604 | 0,10 |
| 288 000 | NESTLE FIN INTL 3,500% 23-17/01/2030 | EUR | 300 050 | 0,29 | 100 000 | AXA SA 22-10/07/2042 FRN | EUR | 82 088 | 0,08 |
| 239 000 | NESTLE FIN INTL 3,750% 23-14/11/2035 | EUR | 255 032 | 0,25 | 400 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 22-16/06/2032 FRN | EUR | 394 822 | 0,39 |
| 512 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 0,875% 19-09/07/2029 | EUR | 449 331 | 0,44 | 400 000 | BNP PARIBAS 20-17/04/2029 FRN | EUR | 360 917 | 0,35 |
| 400 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 4,000% 23-16/09/2025 | EUR | 401 772 | 0,39 | 400 000 | BNP PARIBAS 22-25/07/2028 FRN | EUR | 389 291 | 0,38 |
| 400 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 4,250% 23-16/05/2028 | EUR | 411 056 | 0,40 | 300 000 | BNP PARIBAS 22-31/03/2032 FRN | EUR | 283 807 | 0,28 |
| | <i>Irlande</i> | | 1 950 133 | 1,91 | 400 000 | BNP PARIBAS 23/02/2029 FRN | EUR | 408 573 | 0,40 |
| 500 000 | CA AUTO BANK 4,375% 23-08/06/2026 | EUR | 507 616 | 0,50 | 400 000 | BNP PARIBAS 23-10/01/2031 FRN | EUR | 411 548 | 0,40 |
| 700 000 | DELL BANK INTERN 0,500% 21-27/10/2026 | EUR | 647 513 | 0,64 | 300 000 | BNP PARIBAS 23-13/01/2029 FRN | EUR | 310 434 | 0,30 |
| 505 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,875% 18-15/01/2026 | EUR | 496 822 | 0,48 | 200 000 | BNP PARIBAS 23-13/11/2032 FRN | EUR | 212 037 | 0,21 |
| 295 000 | VODAFONE INT FIN 4,000% 23-10/02/2043 | EUR | 298 182 | 0,29 | 400 000 | BNP PARIBAS 23-26/09/2032 FRN | EUR | 418 643 | 0,41 |
| | <i>Suède</i> | | 1 553 578 | 1,51 | 400 000 | BPCE 21-13/01/2042 FRN | EUR | 362 415 | 0,35 |
| 224 000 | MOLNLYCKE HLD 4,250% 23-08/09/2028 | EUR | 229 644 | 0,22 | 200 000 | BPCE 23-14/06/2034 FRN | EUR | 212 707 | 0,21 |
| 372 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 3,875% 23-10/05/2027 | EUR | 379 488 | 0,37 | 400 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 14-31/10/2049 FRN | EUR | 397 451 | 0,39 |
| 536 000 | SWEDBANK AB 4,625% 23-30/05/2026 | EUR | 541 307 | 0,53 | 100 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 18-29/01/2048 FRN | EUR | 92 743 | 0,09 |
| 390 000 | TELIA CO AB 3,625% 23-22/02/2032 | EUR | 403 139 | 0,39 | 600 000 | CREDIT AGRICOLE SA 22-22/04/2027 FRN | EUR | 578 290 | 0,56 |
| | <i>Finlande</i> | | 901 188 | 0,87 | 200 000 | ORANGE 23-18/04/2172 FRN | EUR | 208 981 | 0,20 |
| 452 000 | NOKIA OYJ 2,000% 19-11/03/2026 | EUR | 434 867 | 0,42 | 500 000 | SOCIETE GENERALE 20-24/11/2030 FRN | EUR | 468 787 | 0,46 |
| 213 000 | STORA ENSO OYJ 4,000% 23-01/06/2026 | EUR | 215 266 | 0,21 | 700 000 | SOCIETE GENERALE 21-02/12/2027 FRN | EUR | 641 451 | 0,63 |
| 245 000 | STORA ENSO OYJ 4,250% 23-01/09/2029 | EUR | 251 055 | 0,24 | 500 000 | SOCIETE GENERALE 21-30/06/2031 FRN | EUR | 459 357 | 0,45 |
| | <i>Japon</i> | | 535 828 | 0,52 | 400 000 | SOGECAP SA 14-29/12/2049 FRN | EUR | 393 493 | 0,38 |
| 300 000 | EAST JAPAN RAIL 3,976% 23-05/09/2032 | EUR | 319 015 | 0,31 | 410 000 | TOTALENERGIES SE 22-31/12/2062 FRN | EUR | 377 618 | 0,37 |
| 200 000 | EAST JAPAN RAIL 4,389% 23-05/09/2043 | EUR | 216 813 | 0,21 | | <i>Espagne</i> | | 5 027 780 | 4,91 |
| | <i>Canada</i> | | 502 406 | 0,49 | 200 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 23-10/05/2026 FRN | EUR | 201 205 | 0,20 |
| 336 000 | MAGNA INTL INC 4,375% 23-17/03/2032 | EUR | 357 995 | 0,35 | 400 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 23-13/01/2031 FRN | EUR | 419 605 | 0,41 |
| 140 000 | ROYAL BANK OF CANADA 4,125% 23-05/07/2028 | EUR | 144 411 | 0,14 | 300 000 | BANCO SABADELL 23-07/02/2029 FRN | EUR | 309 641 | 0,30 |
| | <i>Danemark</i> | | 485 808 | 0,48 | 400 000 | BANCO SABADELL 23-07/06/2029 FRN | EUR | 420 056 | 0,41 |
| 190 000 | CARLSBERG BREW 4,250% 23-05/10/2033 | EUR | 202 016 | 0,20 | 200 000 | BANCO SABADELL 23-08/09/2029 FRN | EUR | 207 857 | 0,20 |
| 278 000 | ORSTED A/S 3,750% 23-01/03/2030 | EUR | 283 792 | 0,28 | 100 000 | BANCO SABADELL 23-16/08/2033 FRN | EUR | 101 109 | 0,10 |
| | <i>Belgique</i> | | 464 418 | 0,45 | 400 000 | BANCO SANTANDER 21-24/06/2029 FRN | EUR | 353 844 | 0,35 |
| 500 000 | ELIA SYSTEM OP 1,500% 18-05/09/2028 | EUR | 464 418 | 0,45 | 200 000 | BANCO SANTANDER 22-27/09/2026 FRN | EUR | 200 223 | 0,20 |
| | | | | | 400 000 | BANCO SANTANDER 23-18/10/2027 FRN | EUR | 409 703 | 0,40 |
| | | | | | 200 000 | BANCO SANTANDER 23-23/08/2033 FRN | EUR | 209 490 | 0,20 |
| | | | | | 300 000 | BANKINTER SA 23-13/09/2031 FRN | EUR | 314 116 | 0,31 |
| | | | | | 300 000 | CAIXABANK 20-10/07/2026 FRN | EUR | 288 110 | 0,28 |
| | | | | | 300 000 | CAIXABANK 21-18/06/2031 FRN | EUR | 279 200 | 0,27 |
| | | | | | 600 000 | CAIXABANK 23-16/05/2027 FRN | EUR | 612 147 | 0,60 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| 400 000 | CAIXABANK 23-19/07/2029 FRN | EUR | 418 071 | 0,41 | 165 000 | BANK OF IRELAND 23-04/07/2031 FRN | EUR | 176 030 | 0,17 |
| 100 000 | CAIXABANK 23-30/05/2034 FRN | EUR | 105 653 | 0,10 | 186 000 | BANK OF IRELAND 23-13/11/2029 FRN | EUR | 193 183 | 0,19 |
| 200 000 | IBERDROLA FIN SA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 177 750 | 0,17 | 164 000 | BANK OF IRELAND 23-16/07/2028 FRN | EUR | 171 402 | 0,17 |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>3 178 884</i> | <i>3,11</i> | | <i>Portugal</i> | | <i>1 317 419</i> | <i>1,29</i> |
| 100 000 | ASR NEDERLAND NV 19-02/05/2049 FRN | EUR | 92 263 | 0,09 | 700 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 21-12/02/2027 FRN | EUR | 661 085 | 0,65 |
| 400 000 | COOPERATIEVE RAB 20-05/05/2028 FRN | EUR | 368 525 | 0,36 | 100 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 23-02/10/2026 FRN | EUR | 102 693 | 0,10 |
| 500 000 | ING GROEP NV 22-23/05/2026 FRN | EUR | 488 923 | 0,48 | 600 000 | CAIXA GERAL DEPO 21-21/09/2027 FRN | EUR | 553 641 | 0,54 |
| 300 000 | ING GROEP NV 23/05/2029 FRN | EUR | 309 011 | 0,30 | | <i>Autriche</i> | | <i>913 838</i> | <i>0,89</i> |
| 200 000 | ING GROEP NV 23/05/2034 FRN | EUR | 212 637 | 0,21 | 300 000 | ERSTE GROUP 23-16/01/2031 FRN | EUR | 310 077 | 0,30 |
| 100 000 | ING GROEP NV 23-20/02/2035 FRN | EUR | 103 255 | 0,10 | 400 000 | RAIFFEISEN BK IN 23-26/01/2027 FRN | EUR | 403 570 | 0,39 |
| 100 000 | NN GROUP NV 22-01/03/2043 FRN | EUR | 101 868 | 0,10 | 200 000 | VIENNA INSURANCE 22-15/06/2042 FRN | EUR | 200 191 | 0,20 |
| 300 000 | SWISS LIFE 16-29/12/2049 FRN | EUR | 296 440 | 0,29 | | <i>Danemark</i> | | <i>838 871</i> | <i>0,82</i> |
| 500 000 | SWISS RE 15-29/12/2049 FRN | EUR | 481 754 | 0,47 | 426 000 | DANSKE BANK A/S 23-21/06/2030 FRN | EUR | 448 786 | 0,44 |
| 100 000 | TELEFONICA EUROP 23-07/09/2172 FRN | EUR | 106 572 | 0,10 | 400 000 | ORSTED A/S 17-24/11/3017 FRN | EUR | 390 085 | 0,38 |
| 110 000 | VOLKSWAGEN INTFN 15-29/12/2049 FRN | EUR | 98 194 | 0,10 | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>612 035</i> | <i>0,60</i> |
| 200 000 | VOLKSWAGEN INTFN 17-31/12/2049 FRN | EUR | 190 298 | 0,19 | 300 000 | JPMORGAN CHASE 23-13/11/2031 FRN | EUR | 316 205 | 0,31 |
| 100 000 | VOLKSWAGEN INTFN 23-06/09/2172 FRN | EUR | 112 164 | 0,11 | 285 000 | MORGAN STANLEY 23-02/03/2029 FRN | EUR | 295 830 | 0,29 |
| 200 000 | VOLKSWAGEN INTFN 23-06/09/2172 FRN | EUR | 216 980 | 0,21 | | <i>Belgique</i> | | <i>503 789</i> | <i>0,49</i> |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>2 796 419</i> | <i>2,74</i> | 100 000 | AGEAS 19-02/07/2049 FRN | EUR | 93 072 | 0,09 |
| 100 000 | BAYER AG 22-25/03/2082 FRN | EUR | 94 975 | 0,09 | 400 000 | KBC GROUP NV 23-28/11/2029 FRN | EUR | 410 717 | 0,40 |
| 100 000 | BAYER AG 23-25/09/2083 FRN | EUR | 101 660 | 0,10 | | <i>Norvège</i> | | <i>454 889</i> | <i>0,44</i> |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 23-18/01/2030 FRN | EUR | 104 634 | 0,10 | 433 000 | DNB BANK ASA 23-01/11/2029 FRN | EUR | 454 889 | 0,44 |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 23-25/03/2029 FRN | EUR | 104 970 | 0,10 | | <i>Grèce</i> | | <i>250 550</i> | <i>0,24</i> |
| 400 000 | DEUTSCHE BANK AG 20-19/05/2031 FRN | EUR | 405 056 | 0,40 | 239 000 | PIRAEUS BANK 23-05/12/2029 FRN | EUR | 250 550 | 0,24 |
| 500 000 | DEUTSCHE BANK AG 20-19/11/2025 FRN | EUR | 486 025 | 0,47 | | <i>Suède</i> | | <i>164 112</i> | <i>0,16</i> |
| 700 000 | DEUTSCHE BANK AG 21-17/02/2027 FRN | EUR | 653 222 | 0,65 | 165 000 | TELIA CO AB 22-21/12/2082 FRN | EUR | 164 112 | 0,16 |
| 400 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-23/02/2028 FRN | EUR | 375 775 | 0,37 | | <i>Finlande</i> | | <i>144 365</i> | <i>0,14</i> |
| 100 000 | HANNOVER RUECKV 21-30/06/2042 FRN | EUR | 80 627 | 0,08 | 139 000 | NORDEA BANK ABP 23-23/02/2034 FRN | EUR | 144 365 | 0,14 |
| 100 000 | HANNOVER RUECKV 22-26/08/2043 FRN | EUR | 111 414 | 0,11 | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 2 997 582 | 2,95 |
| 300 000 | MERCK 20-09/09/2080 FRN | EUR | 278 061 | 0,27 | | <i>Luxembourg</i> | | <i>2 997 582</i> | <i>2,95</i> |
| | <i>Italie</i> | | <i>2 334 712</i> | <i>2,28</i> | 6 999,60 | BNP PARIBAS FUNDS EURO HIGH YIELD BOND - X CAP | EUR | 1 227 940 | 1,21 |
| 200 000 | ENEL SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 174 345 | 0,17 | | BNP PARIBAS FUNDS EURO HIGH YIELD SHORT DURATION BOND - I CAP | EUR | 1 257 694 | 1,24 |
| 200 000 | ENI SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 170 867 | 0,17 | 9 999,94 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - I CAP | EUR | 511 948 | 0,50 |
| 390 000 | INTESA SANPAOLO 23-08/03/2028 FRN | EUR | 403 322 | 0,39 | 3 613,68 | | | | |
| 301 000 | MEDIOBANCA SPA 23-01/02/2030 FRN | EUR | 309 731 | 0,30 | | Total portefeuille-titres | | 100 416 915 | 97,97 |
| 574 000 | MEDIOBANCA SPA 23-14/03/2028 FRN | EUR | 592 831 | 0,58 | | | | | |
| 300 000 | UNICREDIT SPA 21-05/07/2029 FRN | EUR | 266 469 | 0,26 | | | | | |
| 400 000 | UNICREDIT SPA 23-14/02/2030 FRN | EUR | 417 147 | 0,41 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>1 950 502</i> | <i>1,89</i> | | | | | |
| 200 000 | BARCLAYS BANK PLC 21-12/05/2032 FRN | EUR | 162 708 | 0,16 | | | | | |
| 586 000 | BARCLAYS BANK PLC 21-22/03/2031 FRN | EUR | 539 772 | 0,53 | | | | | |
| 100 000 | HSBC HOLDINGS 23/05/2033 FRN | EUR | 105 966 | 0,10 | | | | | |
| 226 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 23-21/09/2031 FRN | EUR | 238 656 | 0,23 | | | | | |
| 300 000 | NATWEST GROUP 21-14/09/2032 FRN | EUR | 265 001 | 0,26 | | | | | |
| 200 000 | SSE PLC 20-31/12/2060 FRN | EUR | 189 174 | 0,18 | | | | | |
| 276 000 | STANDARD CHART 21-17/11/2029 FRN | EUR | 239 982 | 0,23 | | | | | |
| 200 000 | STANDARD CHART 23-10/05/2031 FRN | EUR | 209 243 | 0,20 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>1 887 223</i> | <i>1,85</i> | | | | | |
| 254 000 | AIB GROUP PLC 23/07/2029 FRN | EUR | 261 810 | 0,26 | | | | | |
| 132 000 | AIB GROUP PLC 23-23/10/2031 FRN | EUR | 142 511 | 0,14 | | | | | |
| 700 000 | BANK OF IRELAND 21-10/05/2027 FRN | EUR | 650 609 | 0,64 | | | | | |
| 300 000 | BANK OF IRELAND 22-05/06/2026 FRN | EUR | 291 678 | 0,28 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Green Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 62 738 812 | 62,07 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | | | | | |
| 700 000 | ABN AMRO BANK NV 0,500% 19-15/04/2026 | EUR | 662 053 | 0,65 | 900 000 | CREDIT AGRICOLE SA 0,375% 19-21/10/2025 | EUR | 857 195 | 0,85 |
| 1 000 000 | ABN AMRO BANK NV 0,500% 21-23/09/2029 | EUR | 848 795 | 0,84 | 400 000 | CREDIT AGRICOLE SA 4,375% 23-27/11/2033 | EUR | 419 786 | 0,42 |
| 300 000 | ABN AMRO BANK NV 0,875% 18-22/04/2025 | EUR | 290 041 | 0,29 | 100 000 | FONCIERE DES REGIONS 1,875% 16-20/05/2026 | EUR | 96 218 | 0,10 |
| 1 200 000 | ABN AMRO BANK NV 2,375% 22-01/06/2027 | EUR | 1 167 465 | 1,15 | 300 000 | GECINA 0,875% 21-30/06/2036 | EUR | 221 031 | 0,22 |
| 400 000 | ABN AMRO BANK NV 4,250% 22-21/02/2030 | EUR | 415 141 | 0,41 | 300 000 | GECINA 0,875% 22-25/01/2033 | EUR | 246 870 | 0,24 |
| 300 000 | ABN AMRO BANK NV 5,125% 23-22/02/2028 | GBP | 351 530 | 0,35 | 200 000 | ICADE 1,000% 22-19/01/2030 | EUR | 169 626 | 0,17 |
| 100 000 | AHOLD DELHAIZE 3,500% 23-04/04/2028 | EUR | 101 951 | 0,10 | 400 000 | ICADE 1,500% 17-13/09/2027 | EUR | 371 924 | 0,37 |
| 207 000 | ASR NEDERLAND NV 3,625% 23-12/12/2028 | EUR | 209 712 | 0,21 | 100 000 | PRAEMIA HEALTHCR 5,500% 23-19/09/2028 | EUR | 104 556 | 0,10 |
| 1 700 000 | COOPERATIEVE RAB 0,250% 19-30/10/2026 | EUR | 1 583 348 | 1,57 | 100 000 | RCI BANQUE 4,750% 22-06/07/2027 | EUR | 104 277 | 0,10 |
| 200 000 | CTP NV 1,500% 21-27/09/2031 | EUR | 154 860 | 0,15 | 800 000 | RTE RESEAU DE TR 3,500% 23-07/12/2031 | EUR | 825 123 | 0,82 |
| 100 000 | DIGITAL DUTCH 1,000% 20-15/01/2032 | EUR | 79 607 | 0,08 | 300 000 | SUEZ 4,500% 23-13/11/2033 | EUR | 319 923 | 0,32 |
| 500 000 | DIGITAL DUTCH 1,500% 20-15/03/2030 | EUR | 434 568 | 0,43 | 600 000 | SUEZ 4,625% 22-03/11/2028 | EUR | 634 773 | 0,63 |
| 1 000 000 | DIGITAL INTREPID 0,625% 21-15/07/2031 | EUR | 783 713 | 0,78 | 1 000 000 | SUEZ 5,000% 22-03/11/2032 | EUR | 1 107 370 | 1,10 |
| 1 400 000 | EDP FINANCE BV 0,375% 19-16/09/2026 | EUR | 1 303 200 | 1,29 | 600 000 | UNIBAIL-RODAMCO 1,000% 15-14/03/2025 | EUR | 580 477 | 0,57 |
| 1 200 000 | EDP FINANCE BV 1,875% 18-13/10/2025 | EUR | 1 172 292 | 1,16 | 100 000 | UNIBAIL-RODAMCO 2,500% 14-26/02/2024 | EUR | 99 763 | 0,10 |
| 2 600 000 | EDP FINANCE BV 1,875% 22-21/09/2029 | EUR | 2 425 807 | 2,41 | 800 000 | URW 4,125% 23-11/12/2030 | EUR | 823 302 | 0,81 |
| 700 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1,125% 18-16/09/2026 | EUR | 665 053 | 0,66 | 500 000 | VALEO SE 5,875% 23-12/04/2029 | EUR | 536 133 | 0,53 |
| 121 000 | ENEXIS HOLDING 3,625% 23-12/06/2034 | EUR | 127 466 | 0,13 | 200 000 | VINCI SA 0,000% 20-27/11/2028 | EUR | 175 272 | 0,17 |
| 342 000 | HM FINANCE 4,875% 23-25/10/2031 | EUR | 365 027 | 0,36 | <i>Espagne</i> | | | | |
| 1 400 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 0,375% 16-15/09/2025 | EUR | 1 336 731 | 1,32 | 1 400 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1,000% 19-21/06/2026 | EUR | 1 328 626 | 1,31 |
| 100 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 1,125% 16-21/04/2026 | EUR | 96 260 | 0,10 | 1 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1,375% 18-14/05/2025 | EUR | 969 470 | 0,96 |
| 2 000 000 | ING GROEP NV 2,500% 18-15/11/2030 | EUR | 1 912 752 | 1,90 | 100 000 | BANCO SANTANDER 0,300% 19-04/10/2026 | EUR | 92 869 | 0,09 |
| 100 000 | INNOGY FINANCE 1,250% 17-19/10/2027 | EUR | 93 902 | 0,09 | 1 200 000 | BANCO SANTANDER 1,125% 20-23/06/2027 | EUR | 1 118 914 | 1,11 |
| 600 000 | LEASEPLAN CORP 0,250% 21-07/09/2026 | EUR | 550 635 | 0,54 | 500 000 | BANKINTER SA 0,625% 20-06/10/2027 | EUR | 454 636 | 0,45 |
| 500 000 | LEASEPLAN CORP 0,250% 21-23/02/2026 | EUR | 465 444 | 0,46 | 1 500 000 | CAIXABANK 3,750% 22-07/09/2029 | EUR | 1 537 195 | 1,52 |
| 100 000 | LEASEPLAN CORP 1,375% 19-07/03/2024 | EUR | 99 500 | 0,10 | 481 000 | EDP SERVICIOS 4,125% 23-04/04/2029 | EUR | 500 390 | 0,49 |
| 150 000 | MERCEDES-BENZ IN 3,500% 23-30/05/2026 | EUR | 151 539 | 0,15 | 394 000 | EDP SERVICIOS 4,375% 23-04/04/2032 | EUR | 419 346 | 0,41 |
| 100 000 | MERCEDES-BENZ IN 3,700% 23-30/05/2031 | EUR | 104 445 | 0,10 | 1 000 000 | IBERDROLA FIN SA 0,875% 20-16/06/2025 | EUR | 963 932 | 0,95 |
| 100 000 | NN BANK NV 0,500% 21-21/09/2028 | EUR | 88 127 | 0,09 | 1 200 000 | IBERDROLA FIN SA 1,000% 16-07/03/2024 | EUR | 1 193 268 | 1,18 |
| 100 000 | PHILIPS NV 0,500% 19-22/05/2026 | EUR | 93 212 | 0,09 | 100 000 | IBERDROLA FIN SA 1,250% 17-13/09/2027 | EUR | 95 287 | 0,09 |
| 100 000 | STELLANTIS NV 4,375% 23-14/03/2030 | EUR | 105 487 | 0,10 | 100 000 | IBERDROLA FIN SA 1,375% 22-11/03/2032 | EUR | 88 621 | 0,09 |
| 100 000 | SWISSCOM FIN 0,375% 20-14/11/2028 | EUR | 89 125 | 0,09 | 100 000 | IBERDROLA FIN SA 3,625% 23-13/07/2033 | EUR | 103 528 | 0,10 |
| 100 000 | VOLKSBANK NV 0,250% 21-22/06/2026 | EUR | 91 994 | 0,09 | 300 000 | TELEFONICA EMIS 4,183% 23-21/11/2033 | EUR | 314 923 | 0,31 |
| 100 000 | VOLKSBANK NV 0,375% 21-03/03/2028 | EUR | 86 923 | 0,09 | <i>Italie</i> | | | | |
| 200 000 | VOLKSBANK NV 4,875% 23-07/03/2030 | EUR | 208 201 | 0,21 | 800 000 | ASSICURAZIONI 2,124% 19-01/10/2030 | EUR | 702 142 | 0,69 |
| 100 000 | ZF EUROPE FIN BV 6,125% 23-13/03/2029 | EUR | 106 081 | 0,10 | 100 000 | ASSICURAZIONI 2,429% 20-14/07/2031 | EUR | 86 939 | 0,09 |
| <i>France</i> | | | | | 200 000 | ASSICURAZIONI 5,272% 23-12/09/2033 | EUR | 210 598 | 0,21 |
| 1 500 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,100% 20-08/10/2027 | EUR | 1 342 467 | 1,33 | 300 000 | ASSICURAZIONI 5,800% 22-06/07/2032 | EUR | 321 529 | 0,32 |
| 1 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,250% 21-29/06/2028 | EUR | 968 141 | 0,96 | 100 000 | ERG SPA 0,500% 20-11/09/2027 | EUR | 90 290 | 0,09 |
| 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,125% 23-18/09/2030 | EUR | 104 908 | 0,10 | 100 000 | ERG SPA 0,875% 21-15/09/2031 | EUR | 80 319 | 0,08 |
| 200 000 | BNP PARIBAS 1,125% 19-28/08/2024 | EUR | 196 418 | 0,19 | 100 000 | ERG SPA 1,875% 19-11/04/2025 | EUR | 97 972 | 0,10 |
| 100 000 | BPCE 0,125% 19-04/12/2024 | EUR | 96 926 | 0,10 | 400 000 | FERROVIE DEL 4,500% 23-23/05/2033 | EUR | 418 416 | 0,41 |
| 400 000 | COVIVIO 1,125% 19-17/09/2031 | EUR | 328 725 | 0,33 | 2 900 000 | INTESA SANPAOLO 0,750% 21-16/03/2028 | EUR | 2 607 624 | 2,59 |
| 300 000 | COVIVIO 4,625% 23-05/06/2032 | EUR | 311 020 | 0,31 | 100 000 | INTESA SANPAOLO 4,000% 23-19/05/2026 | EUR | 101 393 | 0,10 |
| | | | | | 600 000 | INTESA SANPAOLO 4,875% 23-19/05/2030 | EUR | 630 840 | 0,62 |
| | | | | | 2 150 000 | INTESA SANPAOLO 5,625% 23-08/03/2033 | EUR | 2 311 588 | 2,30 |
| | | | | | 100 000 | MEDIOBANCA SPA 1,000% 20-08/09/2027 | EUR | 92 043 | 0,09 |
| | | | | | 100 000 | TERNA RETE 3,875% 23-24/07/2033 | EUR | 103 032 | 0,10 |
| | | | | | 100 000 | UNIONE DI BANCHE 1,500% 19-10/04/2024 | EUR | 99 261 | 0,10 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Green Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Allemagne | | | | | Japon | | | | |
| | | | 2 684 592 | 2,64 | | | | 1 053 938 | 1,05 |
| 100 000 | BERLIN HYP AG 0,375% 22-25/01/2027 | EUR | 91 976 | 0,09 | 200 000 | mitsubishi UFJ FINANCE 0,848% 19-19/07/2029 | EUR | 179 042 | 0,18 |
| 100 000 | BERLIN HYP AG 1,500% 18-18/04/2028 | EUR | 91 324 | 0,09 | 100 000 | NIDEC CORP 0,046% 21-30/03/2026 | EUR | 92 188 | 0,09 |
| 100 000 | DAIMLER AG 0,750% 21-11/03/2033 | EUR | 82 429 | 0,08 | 100 000 | SUMITOMO MITSUI 0,465% 19-30/05/2024 | EUR | 98 549 | 0,10 |
| 300 000 | DEUTSCHE WOHNEN 0,500% 21-07/04/2031 | EUR | 245 974 | 0,24 | 700 000 | SUMITOMO MITSUI 0,934% 17-11/10/2024 | EUR | 684 159 | 0,68 |
| 100 000 | DEUTSCHE WOHNEN 1,300% 21-07/04/2041 | EUR | 64 966 | 0,06 | Autriche | | | | |
| 200 000 | E.ON SE 0,000% 19-28/08/2024 | EUR | 194 945 | 0,19 | 200 000 | ERSTE GROUP 0,125% 21-17/05/2028 | EUR | 175 325 | 0,17 |
| 300 000 | EUROGRID GMBH 1,113% 20-15/05/2032 | EUR | 251 794 | 0,25 | 100 000 | RAIFFEISEN BK IN 0,375% 19-25/09/2026 | EUR | 91 322 | 0,09 |
| 400 000 | VOLKSWAGEN LEAS 4,750% 23-25/09/2031 | EUR | 426 067 | 0,42 | Belgique | | | | |
| 500 000 | VONOVIA SE 0,625% 21-24/03/2031 | EUR | 393 328 | 0,39 | 100 000 | BELFIUS BANK SA 3,875% 23-12/06/2028 | EUR | 102 299 | 0,10 |
| 700 000 | VONOVIA SE 5,000% 22-23/11/2030 | EUR | 738 735 | 0,73 | 100 000 | ELIA TRANS BE 3,625% 23-18/01/2033 | EUR | 103 139 | 0,10 |
| 100 000 | ZF FINANCE GMBH 5,750% 23-03/08/2026 | EUR | 103 054 | 0,10 | Canada | | | | |
| Royaume-Uni | | | | | | | | 197 545 | 0,20 |
| | | | 2 015 695 | 1,98 | 200 000 | ROYAL BANK OF CANADA 0,250% 19-02/05/2024 | EUR | 197 545 | 0,20 |
| 100 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 102 861 | 0,10 | Grèce | | | | |
| 178 000 | DS SMITH PLC 4,500% 23-27/07/2030 | EUR | 185 283 | 0,18 | 200 000 | MYTILINEOS SA 2,250% 21-30/10/2026 | EUR | 190 625 | 0,19 |
| 900 000 | SSE PLC 0,875% 17-06/09/2025 | EUR | 863 960 | 0,85 | Danemark | | | | |
| 500 000 | SSE PLC 1,375% 18-04/09/2027 | EUR | 472 325 | 0,47 | 100 000 | JYSKE BANK A/S 5,500% 22-16/11/2027 | EUR | 104 844 | 0,10 |
| 300 000 | SSE PLC 2,875% 22-01/08/2029 | EUR | 296 526 | 0,29 | Roumanie | | | | |
| 100 000 | VODAFONE GROUP 0,900% 19-24/11/2026 | EUR | 94 740 | 0,09 | 100 000 | NE PROPERTY 3,375% 20-14/07/2027 | EUR | 94 014 | 0,09 |
| Etats-Unis d'Amérique | | | | | | | | 94 014 | 0,09 |
| | | | 1 982 795 | 1,96 | Norvège | | | | |
| 527 000 | BANK OF AMERICA CORP 4,134% 23-12/06/2028 | EUR | 543 124 | 0,54 | 100 000 | SPAREBANK 1 OEST 0,125% 21-03/03/2028 | EUR | 87 808 | 0,09 |
| 200 000 | EQUINIX INC 0,250% 21-15/03/2027 | EUR | 181 837 | 0,18 | Liechtenstein | | | | |
| 100 000 | EQUINIX INC 1,000% 21-15/03/2033 | EUR | 80 671 | 0,08 | 100 000 | SWISS LIFE FIN 10,500% 21-15/09/2031 | EUR | 80 970 | 0,08 |
| 200 000 | JOHNSON CONTROLS 4,250% 23-23/05/2035 | EUR | 211 790 | 0,21 | Obligations à taux flottant | | | | |
| 900 000 | PROLOGIS EURO 0,375% 20-06/02/2028 | EUR | 802 145 | 0,79 | | | | 36 505 997 | 36,09 |
| 200 000 | PROLOGIS EURO 1,500% 22-08/02/2034 | EUR | 163 228 | 0,16 | Pays-Bas | | | | |
| Portugal | | | | | | | | 8 766 063 | 8,67 |
| | | | 1 830 938 | 1,81 | 400 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 18-31/12/2049 FRN | EUR | 397 694 | 0,39 |
| 1 700 000 | EDP SA 1,625% 20-15/04/2027 | EUR | 1 625 440 | 1,61 | 600 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 19-31/12/2049 FRN | EUR | 591 863 | 0,59 |
| 200 000 | EDP SA 3,875% 23-26/06/2028 | EUR | 205 498 | 0,20 | 1 100 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 931 868 | 0,92 |
| Finlande | | | | | | | | 545 252 | 0,54 |
| | | | 1 652 172 | 1,64 | 600 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 545 252 | 0,54 |
| 100 000 | NESTE 3,875% 23-16/03/2029 | EUR | 103 038 | 0,10 | 500 000 | ING GROEP NV 21-09/06/2032 FRN | EUR | 448 952 | 0,44 |
| 144 000 | NESTE 3,875% 23-21/05/2031 | EUR | 149 329 | 0,15 | 3 000 000 | ING GROEP NV 22-23/05/2026 FRN | EUR | 2 933 537 | 2,91 |
| 1 000 000 | NORDEA BANK ABP 0,375% 19-28/05/2026 | EUR | 939 067 | 0,93 | 700 000 | ING GROEP NV 22-24/08/2033 FRN | EUR | 702 157 | 0,69 |
| 100 000 | STORA ENSO OYJ 4,000% 23-01/06/2026 | EUR | 101 064 | 0,10 | 1 010 000 | NN GROUP NV 23-03/11/2043 FRN | EUR | 1 075 746 | 1,06 |
| 351 000 | STORA ENSO OYJ 4,250% 23-01/09/2029 | EUR | 359 674 | 0,36 | 300 000 | TELEFONICA EUROP 22-23/11/2171 FRN | EUR | 323 927 | 0,32 |
| Suède | | | | | | | | 513 736 | 0,51 |
| | | | 1 646 389 | 1,62 | 500 000 | TELEFONICA EUROP 23-03/05/2171 FRN | EUR | 513 736 | 0,51 |
| 700 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 0,750% 22-09/08/2027 | EUR | 636 267 | 0,63 | 200 000 | VOLKSWAGEN INTFN 23-06/09/2172 FRN | EUR | 112 164 | 0,11 |
| 200 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 4,000% 22-09/11/2026 | EUR | 203 286 | 0,20 | Espagne | | | | |
| 200 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 4,125% 23-29/06/2027 | EUR | 205 858 | 0,20 | | | | 8 442 250 | 8,35 |
| 324 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 4,375% 23-06/11/2028 | EUR | 335 845 | 0,33 | 600 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 20-31/12/2060 FRN | EUR | 594 897 | 0,59 |
| 300 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 0,010% 20-02/12/2027 | EUR | 265 133 | 0,26 | 100 000 | BANCO CRED SOC C 23-14/09/2029 FRN | EUR | 104 648 | 0,10 |
| Luxembourg | | | | | | | | 94 849 | 0,09 |
| | | | 1 645 200 | 1,63 | 500 000 | BANCO SABADELL 20-11/03/2027 FRN | EUR | 94 849 | 0,09 |
| 300 000 | CPI PROPERTY GRO 1,625% 19-23/04/2027 | EUR | 219 774 | 0,22 | 300 000 | BANCO SABADELL 22-10/11/2028 FRN | EUR | 525 431 | 0,52 |
| 300 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 0,750% 21-23/03/2033 | EUR | 228 513 | 0,23 | 1 400 000 | BANCO SABADELL 23-07/06/2029 FRN | EUR | 315 042 | 0,31 |
| 400 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 0,875% 19-09/07/2029 | EUR | 351 040 | 0,35 | 2 300 000 | BANCO SANTANDER 21-24/06/2029 FRN | EUR | 1 238 453 | 1,22 |
| 325 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 1,625% 20-17/06/2032 | EUR | 272 031 | 0,27 | 1 000 000 | CAIXABANK 20-18/11/2026 FRN | EUR | 2 164 370 | 2,15 |
| 500 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 1,750% 18-15/03/2028 | EUR | 469 808 | 0,46 | 700 000 | CAIXABANK 21-09/02/2029 FRN | EUR | 880 845 | 0,87 |
| 100 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 4,625% 23-21/02/2035 | EUR | 104 034 | 0,10 | 700 000 | CAIXABANK 21-18/06/2031 FRN | EUR | 651 467 | 0,64 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Corporate Green Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 600 000 | CAIXABANK 22-14/11/2030 FRN | EUR | 647 002 | 0,64 | | | | | |
| 700 000 | IBERDROLA FIN SA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 622 127 | 0,62 | | | | | |
| 600 000 | IBERDROLA FIN SA 23-25/07/2171 FRN | EUR | 603 119 | 0,60 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>7 240 117</i> | <i>7,16</i> | | | | | |
| 800 000 | AXA SA 21-07/10/2041 FRN | EUR | 659 648 | 0,65 | | | | | |
| 1 200 000 | BNP PARIBAS 19-04/06/2026 FRN | EUR | 1 145 979 | 1,13 | | | | | |
| 1 000 000 | BNP PARIBAS 20-14/10/2027 FRN | EUR | 921 751 | 0,91 | | | | | |
| 600 000 | BNP PARIBAS 21-30/05/2028 FRN | EUR | 542 887 | 0,54 | | | | | |
| 400 000 | BNP PARIBAS 23-13/01/2029 FRN | EUR | 413 912 | 0,41 | | | | | |
| 400 000 | BNP PARIBAS 23-13/04/2031 FRN | EUR | 413 829 | 0,41 | | | | | |
| 1 100 000 | CNP ASSURANCES 19-27/07/2050 FRN | EUR | 952 813 | 0,94 | | | | | |
| 100 000 | CNP ASSURANCES 23-18/07/2053 FRN | EUR | 103 259 | 0,10 | | | | | |
| 2 300 000 | SOCIETE GENERALE 20-22/09/2028 FRN | EUR | 2 086 039 | 2,07 | | | | | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>3 846 621</i> | <i>3,80</i> | | | | | |
| 1 200 000 | DNB BANK ASA 22-18/01/2028 FRN | EUR | 1 099 453 | 1,09 | | | | | |
| 1 700 000 | DNB BANK ASA 22-21/09/2027 FRN | EUR | 1 693 167 | 1,67 | | | | | |
| 500 000 | DNB BANK ASA 23-01/11/2029 FRN | EUR | 525 276 | 0,52 | | | | | |
| 200 000 | DNB BANK ASA 23-14/03/2029 FRN | EUR | 205 954 | 0,20 | | | | | |
| 322 000 | DNB BANK ASA 23-16/02/2027 FRN | EUR | 322 771 | 0,32 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>3 217 518</i> | <i>3,19</i> | | | | | |
| 200 000 | BANCO BPM SPA 23-14/06/2028 FRN | EUR | 209 271 | 0,21 | | | | | |
| 300 000 | INTESA SANPAOLO 23-08/03/2028 FRN | EUR | 310 248 | 0,31 | | | | | |
| 1 800 000 | UNICREDIT SPA 21-05/07/2029 FRN | EUR | 1 598 815 | 1,58 | | | | | |
| 200 000 | UNICREDIT SPA 22-15/11/2027 FRN | EUR | 211 703 | 0,21 | | | | | |
| 851 000 | UNICREDIT SPA 23-14/02/2030 FRN | EUR | 887 481 | 0,88 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>1 517 760</i> | <i>1,51</i> | | | | | |
| 300 000 | AIB GROUP PLC 21-17/11/2027 FRN | EUR | 275 123 | 0,27 | | | | | |
| 300 000 | AIB GROUP PLC 22-04/07/2026 FRN | EUR | 299 935 | 0,30 | | | | | |
| 269 000 | AIB GROUP PLC 23-23/10/2031 FRN | EUR | 290 420 | 0,29 | | | | | |
| 463 000 | BANK OF IRELAND 23-13/11/2029 FRN | EUR | 480 880 | 0,48 | | | | | |
| 164 000 | BANK OF IRELAND 23-16/07/2028 FRN | EUR | 171 402 | 0,17 | | | | | |
| | <i>Portugal</i> | | <i>828 928</i> | <i>0,82</i> | | | | | |
| 800 000 | EDP SA 23/04/2083 FRN | EUR | 828 928 | 0,82 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>794 619</i> | <i>0,78</i> | | | | | |
| 300 000 | COMMERZBANK AG 20-24/03/2026 FRN | EUR | 287 906 | 0,28 | | | | | |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 22-14/09/2027 FRN | EUR | 97 860 | 0,10 | | | | | |
| 300 000 | COMMERZBANK AG 23-25/03/2029 FRN | EUR | 314 909 | 0,31 | | | | | |
| 100 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-23/02/2028 FRN | EUR | 93 944 | 0,09 | | | | | |
| | <i>Belgique</i> | | <i>744 948</i> | <i>0,73</i> | | | | | |
| 700 000 | KBC GROUP NV 20-16/06/2027 FRN | EUR | 651 511 | 0,64 | | | | | |
| 100 000 | KBC GROUP NV 21-01/03/2027 FRN | EUR | 93 437 | 0,09 | | | | | |
| | <i>Autriche</i> | | <i>288 408</i> | <i>0,28</i> | | | | | |
| 200 000 | ERSTE GROUP 23-16/01/2031 FRN | EUR | 206 718 | 0,20 | | | | | |
| 100 000 | RAIFFEISEN BK IN 21-17/06/2033 FRN | EUR | 81 690 | 0,08 | | | | | |
| | <i>Grèce</i> | | <i>287 522</i> | <i>0,28</i> | | | | | |
| 300 000 | PIRAEUS BANK 21-03/11/2027 FRN | EUR | 287 522 | 0,28 | | | | | |
| | <i>Danemark</i> | | <i>281 620</i> | <i>0,28</i> | | | | | |
| 300 000 | JYSKE BANK A/S 21-02/09/2026 FRN | EUR | 281 620 | 0,28 | | | | | |
| | <i>Finlande</i> | | <i>144 365</i> | <i>0,14</i> | | | | | |
| 139 000 | NORDEA BANK ABP 23-23/02/2034 FRN | EUR | 144 365 | 0,14 | | | | | |
| | <i>Pologne</i> | | <i>105 258</i> | <i>0,10</i> | | | | | |
| 100 000 | MBANK 23-11/09/2027 FRN | EUR | 105 258 | 0,10 | | | | | |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | | | | 86 | 0,00 |
| | <i>Luxembourg</i> | | | | | | | <i>86</i> | <i>0,00</i> |
| | 0,61 BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - ICAP | EUR | | | | | | 86 | 0,00 |
| | Total portefeuille-titres | | | | | | | 99 244 895 | 98,16 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Defensive Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | 202 506 078 93,77 | | | | |
| <i>France</i> | | | | | <i>71 517 976 33,10</i> | | | | |
| 190 135 | AXA SA | EUR | 5 607 081 | 2,60 | | | | | |
| 97 859 | BNP PARIBAS | EUR | 6 124 995 | 2,84 | | | | | |
| 10 666 | BUREAU VERITAS SA | EUR | 243 931 | 0,11 | | | | | |
| 18 651 | CAPGEMINI SE | EUR | 3 520 376 | 1,63 | | | | | |
| 105 953 | CARREFOUR SA | EUR | 1 755 111 | 0,81 | | | | | |
| 67 505 | DANONE | EUR | 3 961 193 | 1,83 | | | | | |
| 11 653 | EIFPAGE SA | EUR | 1 130 574 | 0,52 | | | | | |
| 698 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 1 339 322 | 0,62 | | | | | |
| 5 044 | IPSEN | EUR | 544 248 | 0,25 | | | | | |
| 26 614 | LEGRAND SA | EUR | 2 504 377 | 1,16 | | | | | |
| 18 838 | LOREAL | EUR | 8 489 346 | 3,93 | | | | | |
| 5 691 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 4 174 918 | 1,93 | | | | | |
| 73 801 | MICHELIN (CGDE) | EUR | 2 395 580 | 1,11 | | | | | |
| 323 129 | ORANGE | EUR | 3 329 521 | 1,54 | | | | | |
| 6 888 | PERNOD RICARD SA | EUR | 1 100 358 | 0,51 | | | | | |
| 26 430 | PUBLICIS GROUPE | EUR | 2 220 120 | 1,03 | | | | | |
| 93 159 | SANOFI AVENTIS | EUR | 8 361 953 | 3,87 | | | | | |
| 151 072 | TOTAL SA | EUR | 9 306 036 | 4,31 | | | | | |
| 47 572 | VINCI SA | EUR | 5 408 936 | 2,50 | | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | <i>44 471 197 20,61</i> | | | | |
| 7 793 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 1 885 516 | 0,87 | | | | | |
| 53 904 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 5 432 445 | 2,52 | | | | | |
| 10 241 | BECHTLE AG | EUR | 464 839 | 0,22 | | | | | |
| 14 382 | BEIERSDORF AG | EUR | 1 951 637 | 0,90 | | | | | |
| 19 966 | BRENTNAG AG | EUR | 1 661 571 | 0,77 | | | | | |
| 323 249 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 7 030 666 | 3,26 | | | | | |
| 188 289 | E.ON SE | EUR | 2 287 711 | 1,06 | | | | | |
| 32 985 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG | EUR | 1 252 111 | 0,58 | | | | | |
| 22 083 | GEA GROUP AG | EUR | 832 308 | 0,39 | | | | | |
| 6 713 | HANNOVER RUECK SE | EUR | 1 452 022 | 0,67 | | | | | |
| 24 611 | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | EUR | 1 793 157 | 0,83 | | | | | |
| 92 577 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | EUR | 3 499 411 | 1,62 | | | | | |
| 98 028 | MERCEDES BENZ GROUP AG | EUR | 6 131 651 | 2,84 | | | | | |
| 16 391 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG - REG | EUR | 6 148 264 | 2,85 | | | | | |
| 18 984 | SAP SE | EUR | 2 647 888 | 1,23 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | <i>30 526 536 14,12</i> | | | | |
| 17 926 | ASML HOLDING NV | EUR | 12 220 155 | 5,65 | | | | | |
| 39 121 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 1 670 467 | 0,77 | | | | | |
| 135 238 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | EUR | 3 518 217 | 1,63 | | | | | |
| 674 207 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 2 102 177 | 0,97 | | | | | |
| 284 209 | STELLANTIS NV | EUR | 6 011 020 | 2,78 | | | | | |
| 38 885 | WOLTERS KLUWER | EUR | 5 004 500 | 2,32 | | | | | |
| <i>Espagne</i> | | | | | <i>25 842 627 11,97</i> | | | | |
| 31 265 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS | EUR | 1 255 602 | 0,58 | | | | | |
| 8 365 | AENA SA | EUR | 1 372 697 | 0,64 | | | | | |
| 40 499 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 2 627 575 | 1,22 | | | | | |
| 21 001 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA | EUR | 172 754 | 0,08 | | | | | |
| 56 743 | ENAGAS SA | EUR | 866 182 | 0,40 | | | | | |
| 72 590 | ENDESA SA | EUR | 1 340 011 | 0,62 | | | | | |
| 598 153 | IBERDROLA SA | EUR | 7 100 076 | 3,29 | | | | | |
| 150 049 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | EUR | 5 916 432 | 2,74 | | | | | |
| 50 983 | RED ELECTRICA CORPORACION SA | EUR | 760 157 | 0,35 | | | | | |
| 1 253 860 | TELEFONICA SA | EUR | 4 431 141 | 2,05 | | | | | |
| | | | | | <i>Italie</i> | | | | |
| 196 547 | ASSICURAZIONI GENERALI | EUR | 3 755 030 | 1,74 | | | | | |
| 517 036 | ENEL SPA | EUR | 3 479 652 | 1,61 | | | | | |
| 2 002 269 | INTESA SANPAOLO | EUR | 5 292 998 | 2,45 | | | | | |
| 119 483 | POSTE ITALIANE SPA | EUR | 1 227 688 | 0,57 | | | | | |
| 51 215 | PRYSMIAN SPA | EUR | 2 108 522 | 0,98 | | | | | |
| | | | | | <i>Suisse</i> | | | | |
| 89 788 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 4 059 315 | 1,88 | | | | | |
| | | | | | <i>Irlande</i> | | | | |
| 253 777 | AIB GROUP PLC | EUR | 984 655 | 0,46 | | | | | |
| 118 553 | BANK OF IRELAND GROUP PLC | EUR | 974 269 | 0,45 | | | | | |
| 16 378 | KERRY GROUP PLC - A | EUR | 1 288 293 | 0,60 | | | | | |
| | | | | | <i>Belgique</i> | | | | |
| 21 203 | AGEAS | EUR | 833 490 | 0,39 | | | | | |
| 36 976 | KBC GROEP NV | EUR | 2 171 231 | 1,01 | | | | | |
| | | | | | <i>Portugal</i> | | | | |
| 126 505 | GALP ENERGIA SGPS SA | EUR | 1 687 577 | 0,78 | | | | | |
| 39 648 | JERONIMO MARTINS | EUR | 913 490 | 0,42 | | | | | |
| | | | | | <i>Autriche</i> | | | | |
| 8 508 | VERBUND AG | EUR | 715 097 | 0,33 | | | | | |
| | | | | | <i>Finlande</i> | | | | |
| 50 263 | FORTUM OYJ | EUR | 656 435 | 0,30 | | | | | |
| | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| | | | | | 400 098 0,19 | | | | |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 353,68 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 400 098 | 0,19 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 202 906 176 93,96 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 1 434 537 289 | 99,49 |
| Actions | | | 1 434 537 289 | 99,49 |
| <i>France</i> | | | <i>558 767 480</i> | <i>38,75</i> |
| 282 448 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 49 744 742 | 3,45 |
| 1 040 543 | ALSTOM | EUR | 12 673 814 | 0,88 |
| 2 985 233 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 38 366 215 | 2,66 |
| 257 360 | ESSILORLUXOTTICA | EUR | 46 736 576 | 3,24 |
| 63 924 | KERING | EUR | 25 505 676 | 1,77 |
| 135 011 | LOREAL | EUR | 60 842 707 | 4,22 |
| 124 694 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 91 475 518 | 6,33 |
| 1 262 126 | MICHELIN (CGDE) | EUR | 40 968 610 | 2,84 |
| 183 794 | PERNOD RICARD SA | EUR | 29 361 092 | 2,04 |
| 414 582 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 75 362 716 | 5,23 |
| 1 143 675 | TOTAL SA | EUR | 70 450 380 | 4,89 |
| 1 102 708 | WORLDLINE SA - W/I | EUR | 17 279 434 | 1,20 |
| <i>Allemagne</i> | | | <i>238 215 175</i> | <i>16,53</i> |
| 178 508 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 43 190 011 | 3,00 |
| 149 778 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 27 933 597 | 1,94 |
| 2 530 512 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 55 038 636 | 3,82 |
| 209 248 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | EUR | 7 909 574 | 0,55 |
| 489 019 | SIEMENS AG - REG | EUR | 83 094 108 | 5,76 |
| 211 253 | SYMRISE AG | EUR | 21 049 249 | 1,46 |
| <i>Pays-Bas</i> | | | <i>194 937 030</i> | <i>13,51</i> |
| 173 068 | ASML HOLDING NV | EUR | 117 980 455 | 8,17 |
| 1 527 958 | PROSUS NV | EUR | 41 231 947 | 2,86 |
| 1 384 139 | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | EUR | 35 724 628 | 2,48 |
| <i>Espagne</i> | | | <i>110 839 741</i> | <i>7,68</i> |
| 457 931 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 29 710 563 | 2,06 |
| 12 905 130 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 48 774 939 | 3,38 |
| 2 093 448 | GRIFOLS SA | EUR | 32 354 239 | 2,24 |
| <i>Finlande</i> | | | <i>95 598 597</i> | <i>6,63</i> |
| 1 235 156 | NESTE OYJ | EUR | 39 784 375 | 2,76 |
| 1 823 638 | NORDEA BANK ABP | EUR | 20 472 160 | 1,42 |
| 892 251 | SAMPO OYJ - A | EUR | 35 342 062 | 2,45 |
| <i>Suisse</i> | | | <i>77 647 115</i> | <i>5,39</i> |
| 347 618 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 31 980 856 | 2,22 |
| 1 010 092 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 45 666 259 | 3,17 |
| <i>Italie</i> | | | <i>45 996 963</i> | <i>3,19</i> |
| 17 400 024 | INTESA SANPAOLO | EUR | 45 996 963 | 3,19 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | <i>32 137 513</i> | <i>2,23</i> |
| 87 011 | LINDE PLC | EUR | 32 137 513 | 2,23 |
| <i>Belgique</i> | | | <i>29 644 061</i> | <i>2,06</i> |
| 507 430 | ANHEUSER - BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 29 644 061 | 2,06 |
| <i>Luxembourg</i> | | | <i>27 035 547</i> | <i>1,88</i> |
| 458 385 | EUROFINS SCIENTIFIC | EUR | 27 035 547 | 1,88 |
| <i>Portugal</i> | | | <i>23 718 067</i> | <i>1,64</i> |
| 1 029 430 | JERONIMO MARTINS | EUR | 23 718 067 | 1,64 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 4 276 624 | 0,30 |
| <i>Luxembourg</i> | | | <i>4 276 624</i> | <i>0,30</i> |
| 34 698,35 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 4 276 624 | 0,30 |
| Total portefeuille-titres | | | 1 438 813 913 | 99,79 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Flexible Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Obligations | | 231 127 145 | 75,76 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>74 114 292</i> | <i>24,29</i> | | | | | |
| 3 400 000 | AIR FRANCE-KLM 7,250% 23-31/05/2026 | EUR | 3 622 477 | 1,19 | | | | | |
| 1 500 000 | AIR FRANCE-KLM 8,125% 23-31/05/2028 | EUR | 1 699 627 | 0,56 | | | | | |
| 1 000 000 | ALSTOM S 0,000% 21-11/01/2029 | EUR | 820 840 | 0,27 | | | | | |
| 500 000 | BNP PARIBAS 1,000% 17-29/11/2024 | EUR | 485 499 | 0,16 | | | | | |
| 2 300 000 | CARREFOUR BANQUE 0,107% 21-14/06/2025 | EUR | 2 188 630 | 0,72 | | | | | |
| 3 000 000 | CARREFOUR SA 3,750% 23-10/10/2030 | EUR | 3 058 549 | 1,00 | | | | | |
| 1 700 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 5,875% 23-25/10/2033 | EUR | 1 863 438 | 0,61 | | | | | |
| 1 400 000 | DASSAULT SYSTEME 0,000% 19-16/09/2024 | EUR | 1 363 105 | 0,45 | | | | | |
| 21 889 224 | FRANCE O.A.T. I/L 0,100% 15-01/03/2025 | EUR | 21 578 355 | 7,06 | | | | | |
| 18 631 720 | FRANCE O.A.T. I/L 0,250% 13-25/07/2024 | EUR | 18 509 265 | 6,06 | | | | | |
| 2 100 000 | IMERYS SA 4,750% 23-29/11/2029 | EUR | 2 133 147 | 0,70 | | | | | |
| 1 843 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-02/10/2026 | EUR | 1 889 224 | 0,62 | | | | | |
| 500 000 | RCI BANQUE 4,750% 22-06/07/2027 | EUR | 521 387 | 0,17 | | | | | |
| 2 399 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-14/06/2028 | EUR | 2 521 503 | 0,83 | | | | | |
| 4 973 000 | TEREOS FIN GROUP 4,750% 22-30/04/2027 | EUR | 4 997 084 | 1,64 | | | | | |
| 3 275 000 | TEREOS FIN GROUP 7,250% 23-15/04/2028 | EUR | 3 464 169 | 1,14 | | | | | |
| 3 200 000 | THALES SA 4,250% 23-18/10/2031 | EUR | 3 397 993 | 1,11 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>45 147 480</i> | <i>14,79</i> | | | | | |
| 35 968 896 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND I/L 0,100% 15-15/04/2026 | EUR | 35 377 615 | 11,59 | | | | | |
| 4 753 920 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND I/L 0,100% 21-15/04/2033 | EUR | 4 782 612 | 1,57 | | | | | |
| 2 800 000 | DT LUFTHANSA AG 2,875% 21-16/05/2027 | EUR | 2 694 375 | 0,88 | | | | | |
| 462 000 | FRESENIUS SE & C 1,875% 22-24/05/2025 | EUR | 451 625 | 0,15 | | | | | |
| 1 900 000 | METRO AG 1,500% 15-19/03/2025 | EUR | 1 841 253 | 0,60 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>24 185 431</i> | <i>7,92</i> | | | | | |
| 1 400 000 | AEROPORTI ROMA 4,875% 23-10/07/2033 | EUR | 1 472 921 | 0,48 | | | | | |
| 4 292 000 | FERROVIE DEL 4,500% 23-23/05/2033 | EUR | 4 489 605 | 1,47 | | | | | |
| 1 293 000 | HERA SPA 4,250% 23-20/04/2033 | EUR | 1 340 361 | 0,44 | | | | | |
| 17 140 160 | ITALY BTPS 0,650% 20-15/05/2026 | EUR | 16 882 544 | 5,53 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>23 310 703</i> | <i>7,65</i> | | | | | |
| 2 400 000 | BAXTER INTERNATIONAL 0,400% 19-15/05/2024 | EUR | 2 367 507 | 0,78 | | | | | |
| 223 000 | BOOKING HLDS INC 4,500% 22-15/11/2031 | EUR | 242 724 | 0,08 | | | | | |
| 6 598 000 | FORD MOTOR CREDIT 4,867% 23-03/08/2027 | EUR | 6 780 629 | 2,22 | | | | | |
| 1 159 000 | FORD MOTOR CREDIT 5,125% 23-20/02/2029 | EUR | 1 211 646 | 0,40 | | | | | |
| 3 200 000 | GENERAL ELECTRIC CO 0,875% 17-17/05/2025 | EUR | 3 090 706 | 1,01 | | | | | |
| 3 500 000 | GENERAL ELECTRIC CO 1,500% 17-17/05/2029 | EUR | 3 233 103 | 1,06 | | | | | |
| 3 350 000 | GENERAL MOTORS FIN 4,500% 23-22/11/2027 | EUR | 3 468 606 | 1,14 | | | | | |
| 2 473 000 | IHG FINANCE LLC 4,375% 23-28/11/2029 | EUR | 2 561 415 | 0,84 | | | | | |
| 338 000 | TOYOTA MTR CREDIT 4,050% 23-13/09/2029 | EUR | 354 367 | 0,12 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>19 887 503</i> | <i>6,51</i> | | | | | |
| 2 635 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 2 710 383 | 0,89 | | | | | |
| 5 400 000 | INTERNATIONAL CONSOLIDAT 3,750% 21-25/03/2029 | EUR | 5 224 554 | 1,71 | | | | | |
| 5 300 000 | ROLLS-ROYCE PLC 1,625% 18-09/05/2028 | EUR | 4 878 606 | 1,60 | | | | | |
| 4 400 000 | ROLLS-ROYCE PLC 4,625% 20-16/02/2026 | EUR | 4 468 805 | 1,46 | | | | | |
| 2 509 000 | TESCO CORP TREAS 4,250% 23-27/02/2031 | EUR | 2 605 155 | 0,85 | | | | | |
| | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 530 000 | COCA-COLA HBC BV 2,750% 22-23/09/2025 | EUR | 524 814 | 0,17 | | | | | |
| 1 900 000 | DAIMLER TRUCK 3,875% 23-19/06/2026 | EUR | 1 931 105 | 0,63 | | | | | |
| 3 300 000 | EASYJET FINCO 1,875% 21-03/03/2028 | EUR | 3 080 184 | 1,01 | | | | | |
| 2 053 000 | HM FINANCE 4,875% 23-25/10/2031 | EUR | 2 191 231 | 0,72 | | | | | |
| 3 306 000 | JDE PEETS NV 4,500% 23-23/01/2034 | EUR | 3 471 763 | 1,14 | | | | | |
| 1 000 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 0,125% 20-05/10/2024 | EUR | 972 877 | 0,32 | | | | | |
| 1 061 000 | SCHLUMBERGER FIN 0,000% 19-15/10/2024 | EUR | 1 028 833 | 0,34 | | | | | |
| 3 237 000 | STELLANTIS NV 4,375% 23-14/03/2030 | EUR | 3 414 620 | 1,12 | | | | | |
| | | | | | <i>Finlande</i> | | | | |
| 1 469 000 | NOKIA OYJ 2,000% 19-11/03/2026 | EUR | 1 413 317 | 0,46 | | | | | |
| 2 000 000 | NOKIA OYJ 3,125% 20-15/05/2028 | EUR | 1 953 312 | 0,64 | | | | | |
| 3 300 000 | NOKIA OYJ 4,375% 23-21/08/2031 | EUR | 3 318 049 | 1,09 | | | | | |
| 3 512 000 | STORA ENSO OYJ 4,250% 23-01/09/2029 | EUR | 3 598 790 | 1,18 | | | | | |
| | | | | | <i>Japon</i> | | | | |
| 249 000 | ASAHI GROUP 0,155% 20-23/10/2024 | EUR | 241 676 | 0,08 | | | | | |
| 4 700 000 | NISSAN MOTOR CO 3,201% 20-17/09/2028 | EUR | 4 513 241 | 1,48 | | | | | |
| | | | | | <i>Suède</i> | | | | |
| 4 181 000 | ERICSSON LM 1,125% 22-08/02/2027 | EUR | 3 859 592 | 1,27 | | | | | |
| | | | | | <i>Irlande</i> | | | | |
| 3 200 000 | SMURFIT KAPPA 1,500% 19-15/09/2027 | EUR | 2 998 008 | 0,98 | | | | | |
| 800 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,750% 15-01/02/2025 | EUR | 786 590 | 0,26 | | | | | |
| | | | | | <i>Belgique</i> | | | | |
| 2 000 000 | BELFIUS BANK SA 3,125% 16-11/05/2026 | EUR | 1 969 610 | 0,65 | | | | | |
| | | | | | <i>Danemark</i> | | | | |
| 1 887 000 | CARLSBERG BREW 4,000% 23-05/10/2028 | EUR | 1 954 258 | 0,64 | | | | | |
| | | | | | <i>Espagne</i> | | | | |
| 1 240 940 | SPAIN I/L BOND 1,800% 14-30/11/2024 | EUR | 1 241 763 | 0,41 | | | | | |
| | | | | | <i>Grèce</i> | | | | |
| 7 040 000 | HELLENIC REPUBLIC 0,000% 12-15/10/2042 | EUR | 18 103 | 0,01 | | | | | |
| | | | | | Obligations à taux flottant | | | | |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 4 800 000 | ACCOR 19-31/12/2059 FRN | EUR | 4 668 408 | 1,53 | | | | | |
| 4 000 000 | ACCOR 23-11/04/2172 FRN | EUR | 4 339 291 | 1,42 | | | | | |
| 3 000 000 | BNP PARIBAS 85-29/10/2049 FRN | EUR | 2 100 000 | 0,69 | | | | | |
| 1 800 000 | RCI BANQUE 17-04/11/2024 FRN | EUR | 1 801 966 | 0,59 | | | | | |
| 1 500 000 | RCI BANQUE 18-12/03/2025 FRN | EUR | 1 497 752 | 0,49 | | | | | |
| 688 000 | TOTAL SE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 614 927 | 0,20 | | | | | |
| | | | | | <i>Italie</i> | | | | |
| 4 650 000 | INTESA SANPAOLO 23-16/11/2025 FRN | EUR | 4 659 208 | 1,53 | | | | | |
| 4 300 000 | ITALY CCTS EU 22-15/10/2030 FRN | EUR | 4 232 390 | 1,39 | | | | | |
| 1 400 000 | ITALY CCTS EU 23-15/10/2028 FRN | EUR | 1 404 371 | 0,46 | | | | | |
| 2 800 000 | UNICREDIT SPA 19-23/09/2029 FRN | EUR | 2 729 382 | 0,89 | | | | | |
| | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 1 337 000 | ABB FINANCE BV 22-31/03/2024 FRN | EUR | 1 338 704 | 0,44 | | | | | |
| 3 800 000 | COOPERATIEVE RAB 23-03/11/2026 FRN | EUR | 3 822 529 | 1,25 | | | | | |
| 3 600 000 | ING BANK NV 23-02/10/2026 FRN | EUR | 3 615 922 | 1,19 | | | | | |
| | | | | | <i>Irlande</i> | | | | |
| 6 900 000 | FCA BANK IE 22-24/03/2024 FRN | EUR | 6 916 638 | 2,27 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Flexible Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Royaume-Uni</i> | | 5 289 253 | 1,73 |
| 3 600 000 | BP CAPITAL PLC 20-22/06/2169 FRN | EUR | 3 360 430 | 1,10 |
| 2 000 000 | BP CAPITAL PLC 20-22/06/2169 FRN | EUR | 1 928 823 | 0,63 |
| | <i>Canada</i> | | 3 184 375 | 1,04 |
| 3 178 000 | TORONTO DOMINION BANK 23-21/07/2025 FRN | EUR | 3 184 375 | 1,04 |
| | <i>Allemagne</i> | | 3 006 258 | 0,99 |
| 3 000 000 | LB BADEN-WUERT 23-28/11/2025 FRN | EUR | 3 006 258 | 0,99 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 2 004 920 | 0,66 |
| 2 000 000 | GOLDMAN SACHS GP 21-23/09/2027 FRN | EUR | 2 004 920 | 0,66 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 6 299 565 | 2,06 |
| | <i>France</i> | | 6 169 005 | 2,02 |
| 260,00 | BNP PARIBAS MONEY 3M - IC | EUR | 6 169 005 | 2,02 |
| | <i>Luxembourg</i> | | 130 560 | 0,04 |
| 500,00 | BNP PARIBAS FUNDS EURO HIGH YIELD BOND - 1 - CAP | EUR | 130 560 | 0,04 |
| | Total portefeuille-titres | | 294 653 004 | 96,58 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Government Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | | | | | | | |
| Allemagne | | | | | | | | | |
| 162 519 459 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0,000% 20-15/08/2030 | EUR | 143 805 344 | 7,86 | 2 500 000 | BPCE SFH 0,875% 17-13/04/2028 | EUR | 2 309 070 | 0,13 |
| 51 808 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0,000% 21-15/05/2036 | EUR | 39 789 062 | 2,18 | 9 700 000 | CAISSE AMORT DET 3,000% 23-25/05/2028 | EUR | 9 890 359 | 0,54 |
| 52 116 143 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0,000% 21-15/08/2050 | EUR | 29 173 424 | 1,60 | 12 000 000 | DEXIA CREDIT LOCAL 0,000% 21-21/01/2028 | EUR | 10 833 873 | 0,59 |
| 95 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0,000% 21-15/08/2052 | EUR | 50 714 | 0,00 | 179 000 | FRANCE O.A.T. 0,000% 19-25/11/2029 | EUR | 157 115 | 0,01 |
| 8 225 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 1,800% 22-15/08/2053 | EUR | 7 434 002 | 0,41 | 43 208 000 | FRANCE O.A.T. 0,000% 22-25/05/2032 | EUR | 35 406 796 | 1,94 |
| 22 795 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 2,300% 23-15/02/2033 | EUR | 23 390 177 | 1,28 | 74 135 614 | FRANCE O.A.T. 0,100% 20-01/03/2026 | EUR | 73 435 774 | 4,02 |
| 34 790 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 2,600% 23-15/08/2033 | EUR | 36 569 856 | 2,00 | 11 720 000 | FRANCE O.A.T. 0,500% 20-25/05/2040 | EUR | 8 138 954 | 0,45 |
| 38 580 000 | BUNDESSCHATZANW 2,500% 23-13/03/2025 | EUR | 38 431 853 | 2,10 | 14 009 000 | FRANCE O.A.T. 0,500% 21-25/05/2072 | EUR | 5 907 875 | 0,32 |
| 40 740 000 | KFW 0,000% 21-10/01/2031 | EUR | 34 232 649 | 1,87 | 5 950 000 | FRANCE O.A.T. 0,500% 21-25/06/2044 | EUR | 3 740 349 | 0,20 |
| 15 742 000 | KFW 0,000% 21-15/06/2029 | EUR | 13 819 587 | 0,76 | 12 167 203 | FRANCE O.A.T. 0,750% 21-25/05/2053 | EUR | 6 858 409 | 0,38 |
| 12 412 000 | KFW 0,000% 22-30/04/2027 | EUR | 11 465 957 | 0,63 | 34 489 000 | FRANCE O.A.T. 1,000% 17-25/05/2027 | EUR | 33 088 747 | 1,81 |
| 7 413 000 | KFW 3,125% 23-07/06/2030 | EUR | 7 707 741 | 0,42 | 2 225 000 | FRANCE O.A.T. 1,500% 15-25/05/2031 | EUR | 2 102 714 | 0,12 |
| 10 542 000 | NORDRHEIN-WEST 0,600% 21-04/06/2041 | EUR | 7 169 295 | 0,39 | 28 936 939 | FRANCE O.A.T. 1,500% 19-25/05/2050 | EUR | 21 084 322 | 1,15 |
| Italie | | | | | France | | | | |
| 3 346 000 | ACQUIRENTE UNI 2,800% 19-20/02/2026 | EUR | 3 276 902 | 0,18 | 23 193 749 | FRANCE O.A.T. 1,750% 17-25/06/2039 | EUR | 20 211 497 | 1,11 |
| 30 200 000 | CASSA DEPOSITI E 3,500% 22-19/09/2027 | EUR | 30 407 509 | 1,66 | 9 872 000 | FRANCE O.A.T. 2,000% 22-25/11/2032 | EUR | 9 519 964 | 0,52 |
| 85 120 000 | ITALY BTPS 0,000% 21-01/04/2026 | EUR | 79 884 695 | 4,37 | 338 000 | FRANCE O.A.T. 2,750% 12-25/10/2027 | EUR | 344 236 | 0,02 |
| 4 545 000 | ITALY BTPS 0,950% 20-15/09/2027 | EUR | 4 243 076 | 0,23 | 16 278 881 | FRANCE O.A.T. 3,000% 23-25/05/2054 | EUR | 15 961 352 | 0,87 |
| 71 630 000 | ITALY BTPS 1,350% 19-01/04/2030 | EUR | 64 188 359 | 3,51 | 26 715 000 | FRANCE O.A.T. 4,750% 04-25/04/2035 | EUR | 32 220 694 | 1,76 |
| 1 396 000 | ITALY BTPS 1,450% 18-15/05/2025 | EUR | 1 365 818 | 0,07 | Belgique | | | | |
| 26 695 000 | ITALY BTPS 2,450% 17-01/09/2033 | EUR | 24 242 931 | 1,33 | 24 620 000 | BELGIUM GOVERNMENT 0,650% 21-22/06/2071 | EUR | 11 110 514 | 0,61 |
| 13 589 000 | ITALY BTPS 2,500% 22-01/12/2032 | EUR | 12 552 832 | 0,69 | 47 730 000 | BELGIUM GOVERNMENT 0,800% 18-22/06/2028 | EUR | 44 862 668 | 2,45 |
| 98 352 000 | ITALY BTPS 3,400% 22-01/04/2028 | EUR | 100 088 294 | 5,47 | 3 618 000 | BELGIUM GOVERNMENT 1,000% 16-22/06/2026 | EUR | 3 501 016 | 0,19 |
| 12 565 000 | ITALY BTPS 4,000% 22-30/04/2035 | EUR | 12 792 678 | 0,70 | 3 800 952 | BELGIUM GOVERNMENT 1,400% 22-22/06/2053 | EUR | 2 545 505 | 0,14 |
| 26 378 000 | ITALY BTPS 4,000% 23-30/10/2031 | EUR | 27 492 048 | 1,50 | 1 856 000 | BELGIUM GOVERNMENT 2,150% 16-22/06/2066 | EUR | 1 465 327 | 0,08 |
| Espagne | | | | | Autriche | | | | |
| 4 500 000 | ADIF ALTA VELOCI 0,550% 21-31/10/2031 | EUR | 3 666 015 | 0,20 | 93 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,000% 20-20/10/2040 | EUR | 58 273 | 0,00 |
| 50 100 000 | ADIF ALTA VELOCI 3,500% 22-30/07/2029 | EUR | 51 109 240 | 2,80 | 17 616 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,000% 21-20/02/2031 | EUR | 14 774 442 | 0,81 |
| 7 363 000 | JUNTA ANDALUCIA 0,700% 21-30/07/2033 | EUR | 5 823 578 | 0,32 | 390 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,900% 22-20/02/2032 | EUR | 342 151 | 0,02 |
| 590 000 | JUNTA ANDALUCIA 0,700% 21-30/07/2033 | EUR | 466 646 | 0,03 | 11 005 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 1,850% 22-23/05/2049 | EUR | 8 982 177 | 0,49 |
| 14 367 000 | JUNTA ANDALUCIA 2,400% 22-30/04/2032 | EUR | 13 538 600 | 0,74 | 1 054 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 2,100% 17-20/09/2117 | EUR | 820 293 | 0,04 |
| 80 620 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,000% 21-31/01/2028 | EUR | 72 874 030 | 3,99 | 58 660 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 2,900% 23-20/02/2033 | EUR | 60 037 647 | 3,28 |
| 170 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,000% 20-31/10/2050 | EUR | 95 728 | 0,01 | Finlande | | | | |
| 145 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,000% 21-30/07/2042 | EUR | 97 360 | 0,01 | 2 781 000 | FINNISH GOVERNMENT 1,375% 22-15/04/2027 | EUR | 2 694 608 | 0,15 |
| 2 334 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,450% 21-31/10/2071 | EUR | 1 184 108 | 0,06 | 73 870 000 | FINNISH GOVERNMENT 3,000% 23-15/09/2033 | EUR | 76 451 430 | 4,18 |
| 26 430 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,500% 17-30/04/2027 | EUR | 25 578 161 | 1,40 | Luxembourg | | | | |
| 35 287 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,900% 22-31/10/2052 | EUR | 24 502 940 | 1,34 | 2 403 000 | DUCHY OF LUXEMBOURG 0,000% 20-14/09/2032 | EUR | 1 950 444 | 0,11 |
| 365 000 | SPANISH GOVERNMENT 2,900% 16-31/10/2046 | EUR | 331 274 | 0,02 | 2 212 000 | DUCHY OF LUXEMBOURG 0,625% 17-01/02/2027 | EUR | 2 093 417 | 0,11 |
| 22 300 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,150% 23-30/04/2033 | EUR | 22 639 624 | 1,24 | 11 196 000 | EIB 0,000% 21-28/09/2028 | EUR | 10 018 966 | 0,55 |
| 1 121 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,450% 16-30/07/2066 | EUR | 1 046 449 | 0,06 | 15 853 000 | EIB 2,250% 22-15/03/2030 | EUR | 15 676 033 | 0,86 |
| 8 895 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,450% 22-30/07/2043 | EUR | 8 803 285 | 0,48 | 1 778 308 | ESM 0,000% 21-15/12/2026 | EUR | 1 656 633 | 0,09 |
| 59 277 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,550% 23-31/10/2033 | EUR | 61 983 635 | 3,39 | 34 579 819 | ESM 0,000% 21-15/12/2026 | EUR | 32 213 812 | 1,76 |
| 9 938 000 | SPANISH GOVERNMENT 3,900% 23-30/07/2039 | EUR | 10 522 800 | 0,58 | Pays-Bas | | | | |
| | | | | | 14 250 000 | BNG BANK NV 0,000% 21-20/01/2031 | EUR | 11 860 144 | 0,65 |
| | | | | | 107 789 | NETHERLANDS GOVERNMENT 0,500% 19-15/01/2040 | EUR | 79 920 | 0,00 |
| | | | | | 9 185 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 2,500% 12-15/01/2033 | EUR | 9 353 820 | 0,51 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Government Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|--|--------------------|----------------------|-------------------|
| | <i>Slovaquie</i> | | <i>18 780 374</i> | <i>1,03</i> |
| 7 220 000 | SLOVAKIA GOVERNMENT 0,375% 21-21/04/2036 | EUR | 4 955 447 | 0,27 |
| 13 343 000 | SLOVAKIA GOVERNMENT 4,000% 23-23/02/2043 | EUR | 13 824 927 | 0,76 |
| | <i>Estonie</i> | | <i>689 212</i> | <i>0,04</i> |
| 832 000 | REPUBLIC OF ESTONIA 0,125% 20-10/06/2030 | EUR | 689 212 | 0,04 |
| | <i>Grèce</i> | | <i>11 846</i> | <i>0,00</i> |
| 4 606 900 | HELLENIC REPUBLIC 0,000% 12-15/10/2042 | EUR | 11 846 | 0,00 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 48 076 220 | 2,63 |
| | <i>France</i> | | <i>48 076 220</i> | <i>2,63</i> |
| 80,20 | BNP PARIBAS INVEST 3 MOIS - I - C | EUR | 48 076 220 | 2,63 |
| | Total portefeuille-titres | | 1 790 551 133 | 97,96 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 364 757 632 | 64,76 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 5 223 000 | ALLWYN ENTERTAIN 7,250% 23-30/04/2030 | EUR | 5 484 150 | 0,97 | 2 779 000 | BOELS TOPHOLD 6,250% 23-15/02/2029 | EUR | 2 894 933 | 0,51 |
| 5 447 000 | BELLIS ACQUISITI 3,250% 21-16/02/2026 | GBP | 5 815 530 | 1,03 | 3 317 000 | CONSTELLIUM SE 3,125% 21-15/07/2029 | EUR | 3 040 887 | 0,54 |
| 6 270 000 | CONSTELLATION 4,875% 21-15/07/2027 | GBP | 5 917 458 | 1,05 | 3 050 000 | GRUPO-ANTOLIN 3,375% 18-30/04/2026 | EUR | 2 684 174 | 0,48 |
| 1 484 091 | CO-OPERATIVE GRO 11,000% 13-22/12/2025 | GBP | 1 800 188 | 0,32 | 2 488 000 | IPD 3 BV 8,000% 23-15/06/2028 | EUR | 2 650 883 | 0,47 |
| 5 025 000 | CO-OPERATIVE GRO 5,125% 19-17/05/2024 | GBP | 5 765 385 | 1,02 | 3 257 000 | OI EUROPEAN GRP 6,250% 23-15/05/2028 | EUR | 3 405 047 | 0,60 |
| 4 100 000 | CO-OPERATIVE WHOLESALE 7,500% 11-08/07/2026 | GBP | 4 652 804 | 0,83 | 1 950 000 | Q-PARK HOLDING 1,500% 20-01/03/2025 | EUR | 1 909 050 | 0,34 |
| 4 197 000 | GATWICK AIRPORT 4,375% 21-07/04/2026 | GBP | 4 631 773 | 0,82 | 3 319 000 | Q-PARK HOLDING 2,000% 20-01/03/2027 | EUR | 3 063 437 | 0,54 |
| 4 500 000 | HEATHROW FINANCE 3,875% 17-01/03/2027 | GBP | 4 779 228 | 0,85 | 8 869 000 | TEVA PHARM FNC 7,375% 23-15/09/2029 | EUR | 9 686 809 | 1,73 |
| 4 350 000 | HEATHROW FINANCE PLC 4,125% 19-01/09/2029 | GBP | 4 330 389 | 0,77 | 1 000 000 | TEVA PHARMACEUTICAL FNC 1,875% 15-31/03/2027 | EUR | 908 370 | 0,16 |
| 3 940 000 | INEOS FINANCE PL 2,125% 17-15/11/2025 | EUR | 3 802 568 | 0,68 | 1 600 000 | TRIVIUM PACK FIN 3,750% 19-15/08/2026 | EUR | 1 546 000 | 0,27 |
| 4 200 000 | IRON MOUNTAIN UK 3,875% 17-15/11/2025 | GBP | 4 651 833 | 0,83 | 1 463 000 | VZ SECURED FINAN 3,500% 22-15/01/2032 | EUR | 1 287 798 | 0,23 |
| 4 118 000 | MAISON FINCO PLC 6,000% 21-31/10/2027 | GBP | 4 100 734 | 0,73 | 1 879 000 | ZIGGO 3,375% 20-28/02/2030 | EUR | 1 583 337 | 0,28 |
| 5 500 000 | MARKET BIDCO FIN 5,500% 22-04/11/2027 | GBP | 5 590 656 | 0,99 | <i>France</i> | | | | |
| 6 050 000 | MARKS & SPENCER 3,750% 20-19/05/2026 | GBP | 6 760 957 | 1,20 | 1 700 000 | ALTICE FRANCE 11,500% 24-01/02/2027 | EUR | 1 703 339 | 0,30 |
| 3 400 000 | MARKS & SPENCER 6,000% 12-12/06/2025 | GBP | 3 938 319 | 0,70 | 3 650 000 | ALTICE FRANCE 4,250% 21-15/10/2029 | EUR | 2 885 286 | 0,51 |
| 3 175 000 | RAC BOND CO 5,250% 21-04/11/2027 | GBP | 3 196 617 | 0,57 | 6 000 000 | CGG SA 7,750% 21-01/04/2027 | EUR | 5 499 375 | 0,98 |
| 2 754 000 | RAC BOND CO 8,250% 23-06/11/2028 | GBP | 3 415 882 | 0,61 | 2 000 000 | CROWN EUROPEAN 2,625% 16-30/09/2024 | EUR | 1 971 699 | 0,35 |
| 3 500 000 | SYNTHOMER PLC 3,875% 20-01/07/2025 | EUR | 3 450 417 | 0,61 | 1 200 000 | CROWN EUROPEAN 5,000% 23-15/05/2028 | EUR | 1 242 992 | 0,22 |
| 4 919 000 | TI AUTOMOTIVE 3,750% 21-15/04/2029 | EUR | 4 484 972 | 0,80 | 1 600 000 | ELIOR PARTICIPAT 3,750% 21-15/07/2026 | EUR | 1 475 387 | 0,26 |
| 3 080 000 | TVL FINANCE 10,250% 23-28/04/2028 | GBP | 3 688 920 | 0,65 | 2 000 000 | ERAMET 7,000% 23-22/05/2028 | EUR | 2 033 658 | 0,36 |
| 7 425 000 | VICTORIA PLC 3,625% 21-24/08/2026 | EUR | 5 921 438 | 1,05 | 1 211 000 | FAURECIA 7,250% 22-15/06/2026 | EUR | 1 281 553 | 0,23 |
| <i>Italie</i> | | | | | 2 800 000 | QUATRIM 5,875% 19-15/01/2024 | EUR | 2 333 625 | 0,41 |
| 3 555 000 | ALMAVIVA 4,875% 21-30/10/2026 | EUR | 3 501 675 | 0,62 | 675 000 | QUATRIM 5,875% 19-15/01/2024 | EUR | 562 570 | 0,10 |
| 3 859 000 | LOTTO SPA/ROMA 7,125% 23-01/06/2028 | EUR | 4 060 036 | 0,72 | 3 750 000 | REXEL SA 5,250% 23-15/09/2030 | EUR | 3 906 544 | 0,69 |
| 6 232 000 | NEXI 2,125% 21-30/04/2029 | EUR | 5 491 950 | 0,98 | 7 800 000 | VALLOUREC SA 8,500% 21-30/06/2026 | EUR | 7 837 663 | 1,39 |
| 4 541 000 | PIAGGIO & C 6,500% 23-05/10/2030 | EUR | 4 764 482 | 0,85 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 6 000 000 | TELECOM ITALIA 2,750% 19-15/04/2025 | EUR | 5 832 740 | 1,04 | 1 500 000 | B&M EUROPEAN 8,125% 23-15/11/2030 | GBP | 1 838 712 | 0,33 |
| 6 584 000 | TELECOM ITALIA 6,875% 23-15/02/2028 | EUR | 6 999 472 | 1,24 | 3 050 000 | CIDRON AIDA FINC 5,000% 21-01/04/2028 | EUR | 2 931 961 | 0,52 |
| 6 532 000 | TELECOM ITALIA 7,875% 23-31/07/2028 | EUR | 7 246 709 | 1,29 | 2 303 000 | CIRSA FINANCE IN 4,500% 21-15/03/2027 | EUR | 2 211 291 | 0,39 |
| 656 000 | TIM SPA 4,000% 19-11/04/2024 | EUR | 652 210 | 0,12 | 6 846 000 | CIRSA FINANCE IN 7,875% 23-31/07/2028 | EUR | 7 127 640 | 1,27 |
| 2 317 000 | WEBUILD SPA 3,875% 22-28/07/2026 | EUR | 2 266 388 | 0,40 | 2 496 000 | CONS ENERGY FIN 5,000% 21-15/10/2028 | EUR | 2 019 028 | 0,36 |
| 5 331 000 | WEBUILD SPA 7,000% 23-27/09/2028 | EUR | 5 556 395 | 0,99 | 4 575 000 | CPI PROPERTY GRO 2,750% 20-12/05/2026 | EUR | 3 799 858 | 0,67 |
| <i>Allemagne</i> | | | | | 4 792 000 | INTRALOT CAPITAL 5,250% 17-15/09/2024 | EUR | 3 057 281 | 0,54 |
| 4 000 000 | BLITZ 6,000% 18-30/07/2026 | EUR | 3 505 670 | 0,62 | 3 692 000 | KLEOPATRA FINCO 4,250% 21-01/03/2026 | EUR | 3 044 208 | 0,54 |
| 5 040 000 | CHEPLAPHARM ARZN 7,500% 23-15/05/2030 | EUR | 5 359 736 | 0,95 | 3 919 000 | STENA INTERNATIO 7,250% 23-15/02/2028 | EUR | 4 144 519 | 0,74 |
| 6 800 000 | DOUGLAS GMBH 6,000% 21-08/04/2026 | EUR | 6 720 667 | 1,19 | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 600 000 | GRUENENTHAL GMBH 6,750% 23-15/05/2030 | EUR | 634 961 | 0,11 | 7 231 000 | APL LTD 8,000% 94-15/01/2024 | USD | 6 628 880 | 1,18 |
| 8 100 000 | MAHLE GMBH 2,375% 21-14/05/2028 | EUR | 6 902 369 | 1,23 | 5 650 000 | ARDAGH METAL PAC 3,000% 21-01/09/2029 | EUR | 4 535 877 | 0,81 |
| 7 370 000 | NIDDA HEALTHCARE 7,500% 22-21/08/2026 | EUR | 7 569 137 | 1,34 | 2 567 000 | BANFF MERGER SUB 8,375% 18-01/09/2026 | EUR | 2 542 742 | 0,45 |
| 4 400 000 | TECHEM VERWALTUN 2,000% 20-15/07/2025 | EUR | 4 297 857 | 0,76 | 2 350 000 | BOXER PARENT CO 6,500% 20-02/10/2025 | EUR | 2 351 983 | 0,42 |
| 4 120 000 | TUI CRUISES GMBH 6,500% 21-15/05/2026 | EUR | 4 058 447 | 0,72 | 2 300 000 | CATALANT PHARMA 2,375% 20-01/03/2028 | EUR | 1 994 372 | 0,35 |
| | | | | | 3 177 000 | COTY INC 5,750% 23-15/09/2028 | EUR | 3 335 846 | 0,59 |
| | | | | | 2 000 000 | FORD MOTOR CREDIT 1,744% 20-19/07/2024 | EUR | 1 969 349 | 0,35 |
| | | | | | 4 996 000 | KRONOS INTERNATIONAL INC 3,750% 17-15/09/2025 | EUR | 4 755 568 | 0,84 |
| | | | | | 2 058 000 | ORGANON FIN 1 2,875% 21-30/04/2028 | EUR | 1 881 353 | 0,33 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Espagne</i> | | <i>17 951 517</i> | <i>3,18</i> | 2 500 000 | VEOLIA ENVRNMT 20-20/04/2169 FRN | EUR | 2 232 159 | 0,40 |
| 1 715 000 | EDREAMS ODIGEO S 5,500% 22-15/07/2027 | EUR | 1 705 996 | 0,30 | 3 000 000 | VEOLIA ENVRNMT 21-31/12/2061 FRN | EUR | 2 679 975 | 0,48 |
| 6 082 000 | GRIFOLS ESCROW 3,875% 21-15/10/2028 | EUR | 5 544 681 | 0,98 | 5 000 000 | VEOLIA ENVRNMT 23-22/02/2172 FRN | EUR | 5 244 534 | 0,93 |
| 5 900 000 | GRIFOLS SA 3,200% 17-01/05/2025 | EUR | 5 756 984 | 1,02 | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>30 078 234</i> | <i>5,34</i> |
| 5 184 903 | OHL OPERACIONES 6,600% 21-31/03/2026 | EUR | 4 943 856 | 0,88 | 2 800 000 | BARCLAYS PLC 23-15/06/2171 FRN | GBP | 3 216 165 | 0,57 |
| | <i>Canada</i> | | <i>8 650 541</i> | <i>1,54</i> | 2 547 000 | CENTRICA PLC 15-10/04/2075 FRN | GBP | 2 893 233 | 0,51 |
| 8 750 000 | PANTHER BF AGG 2 4,375% 19-15/05/2026 | EUR | 8 650 541 | 1,54 | 5 400 000 | HSBC HOLDINGS 4,750% 17-31/12/2049 FRN | EUR | 4 873 060 | 0,87 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>7 966 688</i> | <i>1,42</i> | 2 348 000 | MARKS & SPENCER 19-10/07/2027 FRN | GBP | 2 611 243 | 0,46 |
| 4 674 000 | ARDAGH PKG FIN 2,125% 20-15/08/2026 | EUR | 4 159 860 | 0,74 | 4 700 000 | VODAFONE GROUP 18-03/10/2078 FRN | GBP | 5 266 943 | 0,94 |
| 3 687 000 | ENERGIA GROUP 6,875% 23-31/07/2028 | EUR | 3 806 828 | 0,68 | 7 392 000 | VODAFONE GROUP 23-30/08/2084 FRN | EUR | 7 898 155 | 1,40 |
| | <i>Suède</i> | | <i>5 970 974</i> | <i>1,06</i> | 2 700 000 | VODAFONE GROUP 23-30/08/2086 FRN | GBP | 3 319 435 | 0,59 |
| 5 677 000 | VERISURE HOLDING 7,125% 23-01/02/2028 | EUR | 5 970 974 | 1,06 | | <i>Italie</i> | | <i>17 554 969</i> | <i>3,11</i> |
| | <i>Ile de Jersey</i> | | <i>4 053 321</i> | <i>0,72</i> | 4 591 000 | ENEL SPA 23-16/07/2171 FRN | EUR | 4 793 232 | 0,85 |
| 3 350 000 | AA BOND CO LTD 8,450% 23-31/01/2028 | GBP | 4 053 321 | 0,72 | 2 500 000 | ENI SPA 20-31/12/2060 FRN | EUR | 2 280 879 | 0,40 |
| | <i>Pologne</i> | | <i>3 288 472</i> | <i>0,58</i> | 7 935 000 | ENI SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 6 779 167 | 1,20 |
| 3 550 000 | INPOST SA 2,250% 21-15/07/2027 | EUR | 3 288 472 | 0,58 | 3 600 000 | UNICREDIT SPA 19-31/12/2049 FRN | EUR | 3 701 691 | 0,66 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>3 081 871</i> | <i>0,55</i> | | <i>Portugal</i> | | <i>10 361 595</i> | <i>1,85</i> |
| 2 850 000 | AMS-OSRAM AG 10,500% 23-30/03/2029 | EUR | 3 081 871 | 0,55 | 10 000 000 | EDP SA 23/04/2083 FRN | EUR | 10 361 595 | 1,85 |
| | <i>Norvège</i> | | <i>2 474 143</i> | <i>0,44</i> | | <i>Luxembourg</i> | | <i>9 026 472</i> | <i>1,60</i> |
| 2 500 000 | ADEVINTA ASA 2,625% 20-15/11/2025 | EUR | 2 474 143 | 0,44 | 2 690 457 | PAPER INDUSTRIES 23-01/09/2028 FRN | EUR | 1 873 264 | 0,33 |
| | <i>Roumanie</i> | | <i>1 559 584</i> | <i>0,28</i> | 7 897 000 | SES 21-31/12/2061 FRN | EUR | 7 153 208 | 1,27 |
| 1 600 000 | RCS & RDS SA 2,500% 20-05/02/2025 | EUR | 1 559 584 | 0,28 | | <i>Espagne</i> | | <i>8 256 850</i> | <i>1,47</i> |
| | <i>Portugal</i> | | <i>594 518</i> | <i>0,11</i> | 2 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 23-21/09/2171 FRN | EUR | 2 164 942 | 0,38 |
| 600 000 | TAP SGPS SA 5,625% 19-02/12/2024 | EUR | 594 518 | 0,11 | 1 400 000 | BANCO SABADELL 23-18/04/2171 FRN | EUR | 1 494 795 | 0,27 |
| | Obligations convertibles | | 3 744 640 | 0,66 | 5 000 000 | BANCO SANTANDER 20-31/12/2060 FRN | EUR | 4 597 113 | 0,82 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>3 744 640</i> | <i>0,66</i> | | <i>Belgique</i> | | <i>5 105 479</i> | <i>0,90</i> |
| 4 000 000 | AMS AG 0,000% 18-05/03/2025 CV | EUR | 3 744 640 | 0,66 | 2 400 000 | KBC GROUP NV 23-05/03/2172 FRN | EUR | 2 548 410 | 0,45 |
| | Obligations à taux flottant | | 178 296 853 | 31,66 | 2 700 000 | SOLVAY SA 20-02/09/2169 FRN | EUR | 2 557 069 | 0,45 |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>55 449 529</i> | <i>9,84</i> | | <i>Allemagne</i> | | <i>4 161 960</i> | <i>0,74</i> |
| 2 900 000 | ABERTIS FINANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 2 778 328 | 0,49 | 4 400 000 | COMMERZBANK AG 20-31/12/2060 FRN | EUR | 4 161 960 | 0,74 |
| 8 200 000 | ABERTIS FINANCE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 7 460 391 | 1,32 | | Autres valeurs mobilières | | 223 | 0,00 |
| 2 600 000 | ABN AMRO BANK NV 20-31/12/2060 FRN | EUR | 2 481 161 | 0,44 | | Obligations à taux flottant | | 223 | 0,00 |
| 3 085 000 | KONINKLIJKE KPN 22-21/12/2170 FRN | EUR | 3 189 427 | 0,57 | | <i>Luxembourg</i> | | 223 | 0,00 |
| 7 120 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 6 940 779 | 1,23 | 3 000 000 | HELLAS II 06-31/12/2049 DFLT FRN | EUR | 0 | 0,00 |
| 3 000 000 | TELEFONICA EUROP 19-31/12/2049 FRN | EUR | 2 976 855 | 0,53 | 2 228 783 | HELLAS TEL FIN 06-31/12/2049 DFLT FRN | EUR | 223 | 0,00 |
| 6 000 000 | TELEFONICA EUROP 21-31/12/2061 FRN | EUR | 5 204 033 | 0,92 | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 5 817 956 | 1,03 |
| 2 800 000 | TELEFONICA EUROP 22-23/11/2171 FRN | EUR | 3 023 318 | 0,54 | | <i>Luxembourg</i> | | <i>5 817 956</i> | <i>1,03</i> |
| 7 100 000 | TELEFONICA EUROP 23-07/09/2172 FRN | EUR | 7 566 612 | 1,34 | 47 203,93 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 5 817 956 | 1,03 |
| 2 550 000 | TENNET HLD BV 20-22/10/2168 FRN | EUR | 2 469 196 | 0,44 | | Total portefeuille-titres | | 552 617 304 | 98,11 |
| 9 600 000 | WINTERSHALL FIN 21-20/01/2170 FRN | EUR | 8 365 999 | 1,49 | | | | | |
| 3 300 000 | WINTERSHALL FIN 21-20/07/2169 FRN | EUR | 2 993 430 | 0,53 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>38 301 765</i> | <i>6,81</i> | | | | | |
| 3 300 000 | ACCOR 23-11/04/2172 FRN | EUR | 3 579 915 | 0,64 | | | | | |
| 4 600 000 | BNP PARIBAS 23-11/06/2171 FRN | EUR | 4 890 629 | 0,87 | | | | | |
| 3 900 000 | CREDIT AGRICOLE SA 23/03/2171 FRN | EUR | 4 120 747 | 0,73 | | | | | |
| 2 000 000 | ELEC DE FRANCE 13-29/12/2049 FRN | GBP | 2 239 426 | 0,40 | | | | | |
| 6 000 000 | ELEC DE FRANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 5 249 040 | 0,93 | | | | | |
| 7 400 000 | ELEC DE FRANCE 22-06/12/2171 FRN | EUR | 8 065 340 | 1,43 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro High Yield Short Duration Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 212 223 600 | 65,99 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 500 000 | BAA SH PLC 5,750% 14-03/03/2025 | GBP | 571 764 | 0,18 | 1 000 000 | CT INVESTMENT 5,500% 21-15/04/2026 | EUR | 990 575 | 0,31 |
| 1 500 000 | BELLIS ACQUISITI 3,250% 21-16/02/2026 | GBP | 1 601 486 | 0,50 | 3 800 000 | DOUGLAS GMBH 6,000% 21-08/04/2026 | EUR | 3 755 667 | 1,17 |
| 1 500 000 | BELLIS ACQUISITI 4,500% 21-16/02/2026 | GBP | 1 633 563 | 0,51 | 1 000 000 | DT LUFTHANSA AG 2,875% 21-16/05/2027 | EUR | 962 277 | 0,30 |
| 494 318 | CO-OPERATIVE GRO 11,000% 13-22/12/2025 | GBP | 599 603 | 0,19 | 500 000 | DT LUFTHANSA AG 3,000% 20-29/05/2026 | EUR | 485 679 | 0,15 |
| 2 400 000 | CO-OPERATIVE GRO 5,125% 19-17/05/2024 | GBP | 2 753 617 | 0,86 | 349 000 | GRUENTHAL GMBH 3,625% 21-15/11/2026 | EUR | 343 635 | 0,11 |
| 1 050 000 | CO-OPERATIVE WHOLESALE 7,500% 11-08/07/2026 | GBP | 1 191 572 | 0,37 | 6 405 000 | NIDDA HEALTHCARE 7,500% 22-21/08/2026 | EUR | 6 578 063 | 2,04 |
| 2 678 000 | GATWICK AIRPORT 4,375% 21-07/04/2026 | GBP | 2 955 418 | 0,92 | 2 500 000 | TECHEM VERWALTUN 2,000% 20-15/07/2025 | EUR | 2 441 964 | 0,76 |
| 1 000 000 | HEATHROW FINANCE 3,875% 17-01/03/2027 | GBP | 1 062 051 | 0,33 | 2 950 000 | TUI CRUISES GMBH 6,500% 21-15/05/2026 | EUR | 2 905 927 | 0,90 |
| 1 930 000 | HEATHROW FINANCE 4,750% 18-01/03/2024 | GBP | 2 218 464 | 0,69 | 1 900 000 | ZF FINANCE GMBH 5,750% 23-03/08/2026 | EUR | 1 958 034 | 0,61 |
| 1 500 000 | INEOS FINANCE PL 2,125% 17-15/11/2025 | EUR | 1 447 678 | 0,45 | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 1 400 000 | INTERNATIONAL GAME TECH 6,250% 18-15/01/2027 | USD | 1 291 386 | 0,40 | 1 071 000 | BOELS TOPHOLD 6,250% 23-15/02/2029 | EUR | 1 115 679 | 0,35 |
| 2 279 000 | IRON MOUNTAIN UK 3,875% 17-15/11/2025 | GBP | 2 524 173 | 0,78 | 2 000 000 | CONSTELLIUM NV 4,250% 17-15/02/2026 | EUR | 1 987 186 | 0,62 |
| 1 000 000 | MAISON FINCO PLC 6,000% 21-31/10/2027 | GBP | 995 807 | 0,31 | 1 900 000 | GRUPO-ANTOLIN 3,375% 18-30/04/2026 | EUR | 1 672 109 | 0,52 |
| 3 400 000 | MARKET BIDCO FIN 5,500% 22-04/11/2027 | GBP | 3 456 042 | 1,07 | 1 000 000 | ING GROEP NV 6,500% 15-29/12/2049 | USD | 885 608 | 0,28 |
| 1 300 000 | MARKS & SPENCER 3,750% 20-19/05/2026 | GBP | 1 452 768 | 0,45 | 500 000 | IPD 3 BV 8,000% 23-15/06/2028 | EUR | 532 734 | 0,17 |
| 2 000 000 | MARKS & SPENCER 6,000% 12-12/06/2025 | GBP | 2 316 658 | 0,72 | 1 054 000 | NOBIAN FINANCE B 3,625% 21-15/07/2026 | EUR | 1 010 852 | 0,31 |
| 1 600 000 | PUNCH FINANCE 6,125% 21-30/06/2026 | GBP | 1 709 282 | 0,53 | 1 344 000 | OI EUROPEAN GRP 2,875% 19-15/02/2025 | EUR | 1 325 522 | 0,41 |
| 1 125 000 | RAC BOND CO 5,250% 21-04/11/2027 | GBP | 1 132 660 | 0,35 | 1 036 000 | OI EUROPEAN GRP 6,250% 23-15/05/2028 | EUR | 1 083 091 | 0,34 |
| 2 000 000 | STONEGATE PUB 8,250% 20-31/07/2025 | GBP | 2 251 595 | 0,70 | 1 700 000 | PPF ARENA 1 B 2,125% 19-31/01/2025 | EUR | 1 659 108 | 0,52 |
| 1 500 000 | SYNTHOMER PLC 3,875% 20-01/07/2025 | EUR | 1 478 750 | 0,46 | 800 000 | Q-PARK HOLDING 1,500% 20-01/03/2025 | EUR | 783 200 | 0,24 |
| 850 000 | TVL FINANCE 10,250% 23-28/04/2028 | GBP | 1 018 046 | 0,32 | 2 800 000 | SUMMER BIDCO 0,000% 19-15/11/2025 | EUR | 3 512 812 | 1,09 |
| 108 480 | UNIQUE PUB FIN 7,395% 99-28/03/2024 | GBP | 123 739 | 0,04 | 5 130 000 | TEVA PHARM FNC 6,000% 20-31/01/2025 | EUR | 5 172 938 | 1,60 |
| 3 750 000 | VICTORIA PLC 3,625% 21-24/08/2026 | EUR | 2 990 625 | 0,93 | 800 000 | TEVA PHARMACEUTICAL 7,125% 20-31/01/2025 | USD | 727 434 | 0,23 |
| 1 200 000 | VIRGIN MEDIA SEC 5,000% 17-15/04/2027 | GBP | 1 345 923 | 0,42 | 1 300 000 | TRIVIUM PACK FIN 3,750% 19-15/08/2026 | EUR | 1 256 125 | 0,39 |
| <i>France</i> | | | | | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 1 000 000 | ALTICE FRANCE 2,500% 19-15/01/2025 | EUR | 962 167 | 0,30 | 2 316 000 | ALBION FINANCING 5,250% 21-15/10/2026 | EUR | 2 309 728 | 0,72 |
| 1 800 000 | ALTICE FRANCE 5,875% 18-01/02/2027 | EUR | 1 596 010 | 0,50 | 3 000 000 | CIDRON AIDA FINC 5,000% 21-01/04/2028 | EUR | 2 883 896 | 0,90 |
| 2 800 000 | ATOS SE 1,750% 18-07/05/2025 | EUR | 2 117 668 | 0,66 | 1 100 000 | CIRSA FINANCE IN 10,375% 22-30/11/2027 | EUR | 1 197 281 | 0,37 |
| 959 000 | BANIJAY ENTERTAI 7,000% 23-01/05/2029 | EUR | 1 009 838 | 0,31 | 2 000 000 | CIRSA FINANCE IN 4,750% 19-22/05/2025 | EUR | 1 997 492 | 0,62 |
| 1 600 000 | BANIJAY GROUP 6,500% 20-01/03/2026 | EUR | 1 594 663 | 0,50 | 800 000 | CONS ENERGY FIN 6,500% 18-15/05/2026 | USD | 660 481 | 0,21 |
| 2 050 000 | CGG SA 7,750% 21-01/04/2027 | EUR | 1 878 953 | 0,58 | 2 500 000 | CPI PROPERTY GRO 2,750% 20-12/05/2026 | EUR | 2 076 425 | 0,65 |
| 2 500 000 | CGG SA 8,750% 21-01/04/2027 | USD | 2 054 678 | 0,64 | 1 874 000 | INTRALOT CAPITAL 5,250% 17-15/09/2024 | EUR | 1 195 606 | 0,37 |
| 2 166 000 | ELIOR PARTICIPAT 3,750% 21-15/07/2026 | EUR | 1 997 305 | 0,62 | 2 385 000 | KLEOPATRA FINCO 4,250% 21-01/03/2026 | EUR | 1 966 532 | 0,61 |
| 1 200 000 | ERAMET 5,875% 19-21/05/2025 | EUR | 1 208 513 | 0,38 | 1 500 000 | LHMC FINCO 2 7,250% 19-02/10/2025 | EUR | 1 485 643 | 0,46 |
| 1 380 000 | FAURECIA 7,250% 22-15/06/2026 | EUR | 1 460 399 | 0,45 | 600 000 | STENA INTERNATIO 3,750% 20-01/02/2025 | EUR | 594 242 | 0,18 |
| 3 000 000 | ILIAD HOLDING 5,125% 21-15/10/2026 | EUR | 2 982 811 | 0,93 | 2 048 000 | STENA INTERNATIO 7,250% 23-15/02/2028 | EUR | 2 165 852 | 0,67 |
| 1 002 000 | QUATRIM 5,875% 19-15/01/2024 | EUR | 835 104 | 0,26 | <i>Italie</i> | | | | |
| 459 000 | TEREOS FIN GROUP 7,250% 23-15/04/2028 | EUR | 485 513 | 0,15 | 2 000 000 | ALMAVIVA 4,875% 21-30/10/2026 | EUR | 1 970 000 | 0,61 |
| 1 000 000 | TEREOS FIN GROUP 7,500% 20-30/10/2025 | EUR | 1 018 275 | 0,32 | 939 000 | LOTTOMATICA SPA 9,750% 22-30/09/2027 | EUR | 1 014 398 | 0,32 |
| 1 400 000 | VALEO SA 5,375% 22-28/05/2027 | EUR | 1 452 393 | 0,45 | 2 500 000 | TELECOM ITALIA 3,000% 16-30/09/2025 | EUR | 2 434 687 | 0,76 |
| 5 500 000 | VALLOUREC SA 8,500% 21-30/06/2026 | EUR | 5 526 557 | 1,71 | 2 300 000 | TELECOM ITALIA 3,625% 16-25/05/2026 | EUR | 2 255 739 | 0,70 |
| <i>Allemagne</i> | | | | | 1 500 000 | TELECOM ITALIA 5,303% 14-30/05/2024 | USD | 1 354 427 | 0,42 |
| 900 000 | BLITZ 6,000% 18-30/07/2026 | EUR | 788 776 | 0,25 | 1 533 000 | TELECOM ITALIA 6,875% 23-15/02/2028 | EUR | 1 629 737 | 0,51 |
| 1 000 000 | CHEPLAPHARM ARZN 3,500% 20-11/02/2027 | EUR | 966 551 | 0,30 | 1 500 000 | TELECOM ITALIA 7,875% 23-31/07/2028 | EUR | 1 664 125 | 0,52 |
| 1 000 000 | CHEPLAPHARM ARZN 4,375% 20-15/01/2028 | EUR | 973 200 | 0,30 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro High Yield Short Duration Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 2 549 000 | WEBUILD SPA 3,875% 22-28/07/2026 | EUR | 2 493 320 | 0,78 | | | | | |
| 217 000 | WEBUILD SPA 5,875% 20-15/12/2025 | EUR | 220 595 | 0,07 | | | | | |
| 2 437 000 | WEBUILD SPA 7,000% 23-27/09/2028 | EUR | 2 540 036 | 0,79 | | | | | |
| | Etats-Unis d'Amérique | | 17 385 748 | 5,42 | | | | | |
| 1 200 000 | AXALTA COAT/BV 4,750% 20-15/06/2027 | USD | 1 057 512 | 0,33 | | | | | |
| 700 000 | BANFF MERGER SUB 8,375% 18-01/09/2026 | EUR | 693 385 | 0,22 | | | | | |
| 2 610 000 | BOXER PARENT CO 6,500% 20-02/10/2025 | EUR | 2 612 202 | 0,81 | | | | | |
| 1 600 000 | CATALENT PHARMA 5,000% 19-15/07/2027 | USD | 1 397 728 | 0,43 | | | | | |
| 500 000 | CEDAR FAIR LP 5,375% 18-15/04/2027 | USD | 444 145 | 0,14 | | | | | |
| 1 000 000 | CLEVELAND-CLIFFS 5,875% 20-01/06/2027 | USD | 903 382 | 0,28 | | | | | |
| 1 500 000 | COTY INC 4,750% 18-15/04/2026 | EUR | 1 493 129 | 0,46 | | | | | |
| 1 283 000 | COTY INC 5,750% 23-15/09/2028 | EUR | 1 347 149 | 0,42 | | | | | |
| 1 200 000 | GRAY TELE INC 5,875% 16-15/07/2026 | USD | 1 055 606 | 0,33 | | | | | |
| 500 000 | HERC HOLDINGS 5,500% 19-15/07/2027 | USD | 445 833 | 0,14 | | | | | |
| 1 754 000 | KRONOS INTERNATIONAL INC 3,750% 17-15/09/2025 | EUR | 1 669 589 | 0,52 | | | | | |
| 1 000 000 | L BRANDS INC 9,375% 20-01/07/2025 | USD | 951 771 | 0,30 | | | | | |
| 700 000 | LIVE NATION ENT 5,625% 18-15/03/2026 | USD | 627 893 | 0,20 | | | | | |
| 529 000 | MANITOWOC CO 9,000% 19-01/04/2026 | USD | 482 151 | 0,15 | | | | | |
| 2 500 000 | UNITED AIRLINES 4,375% 21-15/04/2026 | USD | 2 204 273 | 0,69 | | | | | |
| | Espagne | | 15 281 372 | 4,74 | | | | | |
| 1 000 000 | GRIFOLS SA 2,250% 19-15/11/2027 | EUR | 939 239 | 0,29 | | | | | |
| 5 832 000 | GRIFOLS SA 3,200% 17-01/05/2025 | EUR | 5 690 632 | 1,76 | | | | | |
| 2 400 000 | LORCA TELECOM 4,000% 20-18/09/2027 | EUR | 2 334 350 | 0,73 | | | | | |
| 3 627 000 | NH HOTEL GRP 4,000% 21-02/07/2026 | EUR | 3 582 200 | 1,11 | | | | | |
| 2 868 299 | OHL OPERACIONES 6,600% 21-31/03/2026 | EUR | 2 734 951 | 0,85 | | | | | |
| | Irlande | | 5 523 712 | 1,71 | | | | | |
| 2 789 000 | ARDAGH PKG FIN 2,125% 20-15/08/2026 | EUR | 2 482 210 | 0,77 | | | | | |
| 1 000 000 | ARDAGH PKG FIN 5,250% 20-30/04/2025 | USD | 877 382 | 0,27 | | | | | |
| 2 096 000 | ENERGIA GROUP 6,875% 23-31/07/2028 | EUR | 2 164 120 | 0,67 | | | | | |
| | Suède | | 3 996 113 | 1,24 | | | | | |
| 1 007 000 | STENA AB 7,000% 14-01/02/2024 | USD | 912 480 | 0,28 | | | | | |
| 700 000 | VERISURE HOLDING 3,875% 20-15/07/2026 | EUR | 686 498 | 0,21 | | | | | |
| 445 000 | VERISURE HOLDING 7,125% 23-01/02/2028 | EUR | 468 044 | 0,15 | | | | | |
| 1 797 000 | VERISURE HOLDING 9,250% 22-15/10/2027 | EUR | 1 929 091 | 0,60 | | | | | |
| | Roumanie | | 3 898 960 | 1,20 | | | | | |
| 4 000 000 | RCS & RDS SA 2,500% 20-05/02/2025 | EUR | 3 898 960 | 1,20 | | | | | |
| | Canada | | 3 262 490 | 1,01 | | | | | |
| 3 300 000 | PANTHER BF AGG 2 4,375% 19-15/05/2026 | EUR | 3 262 490 | 1,01 | | | | | |
| | Autriche | | 2 636 352 | 0,82 | | | | | |
| 2 438 000 | AMS-OSRAM AG 10,500% 23-30/03/2029 | EUR | 2 636 352 | 0,82 | | | | | |
| | Portugal | | 2 378 071 | 0,74 | | | | | |
| 2 400 000 | TAP SGPS SA 5,625% 19-02/12/2024 | EUR | 2 378 071 | 0,74 | | | | | |
| | Ile de Man | | 1 989 312 | 0,62 | | | | | |
| 2 000 000 | PLAYTECH PLC 5,875% 23-28/06/2028 | EUR | 1 989 312 | 0,62 | | | | | |
| | Bermudes | | 1 966 632 | 0,61 | | | | | |
| 2 000 000 | CARNIVAL HLD BM 10,375% 22-01/05/2028 | USD | 1 966 632 | 0,61 | | | | | |
| | Ile de Jersey | | 1 384 417 | 0,43 | | | | | |
| 1 200 000 | AA BOND CO LTD 6,269% 13-31/07/2025 | GBP | 1 384 417 | 0,43 | | | | | |
| | République tchèque | | 1 120 320 | 0,35 | | | | | |
| 1 167 000 | SAZKA GROUP AS 3,875% 20-15/02/2027 | EUR | 1 120 320 | 0,35 | | | | | |
| | Pologne | | 1 111 596 | 0,35 | | | | | |
| 1 200 000 | INPOST SA 2,250% 21-15/07/2027 | EUR | 1 111 596 | 0,35 | | | | | |
| | Obligations convertibles | | 2 621 248 | 0,82 | | | | | |
| | Autriche | | 2 621 248 | 0,82 | | | | | |
| 2 800 000 | AMS AG 0,000% 18-05/03/2025 CV | EUR | 2 621 248 | 0,82 | | | | | |
| | Obligations à taux flottant | | 89 572 956 | 27,85 | | | | | |
| | Pays-Bas | | 21 929 961 | 6,81 | | | | | |
| 4 500 000 | ABERTIS FINANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 4 311 199 | 1,33 | | | | | |
| 2 000 000 | COOPERATIEVE RAB 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 924 476 | 0,60 | | | | | |
| 1 167 000 | IPD 3 BV 23-15/06/2028 FRN | EUR | 1 181 931 | 0,37 | | | | | |
| 1 000 000 | KONINKLIJKE KPN 19-08/02/2168 FRN | EUR | 968 526 | 0,30 | | | | | |
| 2 700 000 | Q-PARK HOLDING 20-01/03/2026 FRN | EUR | 2 682 643 | 0,83 | | | | | |
| 2 000 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 955 518 | 0,61 | | | | | |
| 1 000 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 974 828 | 0,30 | | | | | |
| 3 000 000 | TELEFONICA EUROP 19-31/12/2049 FRN | EUR | 2 976 855 | 0,93 | | | | | |
| 1 650 000 | TENNET HLD BV 20-22/10/2168 FRN | EUR | 1 597 715 | 0,50 | | | | | |
| 3 700 000 | WINTERSHALL FIN 21-20/07/2169 FRN | EUR | 3 356 270 | 1,04 | | | | | |
| | France | | 16 610 422 | 5,17 | | | | | |
| 2 100 000 | ACCOR 19-31/12/2059 FRN | EUR | 2 042 429 | 0,64 | | | | | |
| 2 000 000 | BNP PARIBAS 15-29/08/2049 FRN | USD | 1 820 564 | 0,57 | | | | | |
| 1 000 000 | BNP PARIBAS 19-31/12/2049 FRN | USD | 902 753 | 0,28 | | | | | |
| 2 000 000 | ELEC DE FRANCE 13-29/01/2049 FRN | EUR | 2 002 313 | 0,62 | | | | | |
| 2 000 000 | ELEC DE FRANCE 13-29/12/2049 FRN | GBP | 2 239 426 | 0,70 | | | | | |
| 2 000 000 | ELEC DE FRANCE 14-22/01/2049 FRN | EUR | 1 991 804 | 0,62 | | | | | |
| 1 600 000 | ELEC DE FRANCE 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 584 573 | 0,49 | | | | | |
| 1 600 000 | ELEC DE FRANCE 20-15/03/2169 FRN | EUR | 1 479 502 | 0,46 | | | | | |
| 800 000 | LA POSTE 18-31/12/2049 FRN | EUR | 766 440 | 0,24 | | | | | |
| 300 000 | SOCIETE GENERALE 15-29/12/2049 FRN | USD | 271 258 | 0,08 | | | | | |
| 1 600 000 | VEOLIA ENVRNMT 20-20/04/2169 FRN | EUR | 1 509 360 | 0,47 | | | | | |
| | Italie | | 14 425 642 | 4,50 | | | | | |
| 1 000 000 | BANCO BPM SPA 20-31/12/2060 FRN | EUR | 989 640 | 0,31 | | | | | |
| 2 000 000 | ENI SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 1 821 671 | 0,57 | | | | | |
| 2 000 000 | FIBER BIDCO SPA 22-25/10/2027 FRN | EUR | 2 030 490 | 0,63 | | | | | |
| 2 600 000 | INTESA SANPAOLO 15-29/12/2049 FRN | USD | 2 319 637 | 0,72 | | | | | |
| 2 900 000 | LOTTO SPA/ROMA 23-01/06/2028 FRN | EUR | 2 923 925 | 0,91 | | | | | |
| 500 000 | LOTTO SPA/ROMA 23-15/12/2030 FRN | EUR | 503 383 | 0,16 | | | | | |
| 1 400 000 | UNICREDIT SPA 17-31/12/2049 FRN | EUR | 1 369 102 | 0,43 | | | | | |
| 2 400 000 | UNICREDIT SPA 19-31/12/2049 FRN | EUR | 2 467 794 | 0,77 | | | | | |
| | Royaume-Uni | | 10 360 927 | 3,23 | | | | | |
| 600 000 | ALLWYN ENTERTAIN 22-15/02/2028 FRN | EUR | 609 000 | 0,19 | | | | | |
| 2 000 000 | BARCLAYS PLC 19-31/12/2049 FRN | GBP | 2 241 648 | 0,70 | | | | | |
| 2 173 000 | CENTRICA PLC 15-10/04/2075 FRN | GBP | 2 468 392 | 0,77 | | | | | |
| 1 700 000 | STONEGATE PUB 20-31/07/2025 FRN | EUR | 1 657 302 | 0,52 | | | | | |
| 550 000 | TVL FINANCE 23-28/04/2028 FRN | EUR | 560 607 | 0,17 | | | | | |
| 2 520 000 | VODAFONE GROUP 18-03/10/2078 FRN | GBP | 2 823 978 | 0,88 | | | | | |
| | Luxembourg | | 9 845 346 | 3,05 | | | | | |
| 1 000 000 | CIRSA FINANCE IN 23-31/07/2028 FRN | EUR | 1 007 518 | 0,31 | | | | | |
| 1 000 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 17-31/12/2049 FRN | EUR | 959 684 | 0,30 | | | | | |
| 800 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 23-24/07/2171 FRN | EUR | 829 156 | 0,26 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro High Yield Short Duration Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 877 107 | PAPER INDUSTRIES 23-01/09/2028 FRN | EUR | 610 697 | 0,19 |
| 2 090 000 | ROSSINI SARL 19-30/10/2025 FRN | EUR | 2 090 387 | 0,65 |
| 4 800 000 | SES 21-31/12/2061 FRN | EUR | 4 347 904 | 1,34 |
| | <i>Espagne</i> | | <i>8 876 839</i> | <i>2,75</i> |
| 1 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 19-31/12/2049 FRN | EUR | 996 113 | 0,31 |
| 1 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 19-05/12/2167 FRN | USD | 887 907 | 0,28 |
| 1 000 000 | BANCO SABADELL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 946 483 | 0,29 |
| 2 000 000 | BANCO SANTANDER 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 848 313 | 0,57 |
| 1 000 000 | BANCO SANTANDER 19-31/12/2049 FRN | USD | 904 495 | 0,28 |
| 2 000 000 | CAIXABANK 17-31/12/2049 FRN | EUR | 1 995 123 | 0,62 |
| 1 400 000 | CAIXABANK 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 298 405 | 0,40 |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>4 630 619</i> | <i>1,44</i> |
| 1 500 000 | CHEPLAPHARM ARZN 23-15/05/2030 FRN | EUR | 1 534 585 | 0,48 |
| 1 600 000 | COMMERZBANK AG 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 544 720 | 0,48 |
| 1 600 000 | DT LUFTHANSA AG 15-12/08/2075 FRN | EUR | 1 551 314 | 0,48 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>2 893 200</i> | <i>0,90</i> |
| 1 600 000 | KBC GROUP NV 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 472 606 | 0,46 |
| 1 500 000 | SOLVAY SA 20-02/09/2169 FRN | EUR | 1 420 594 | 0,44 |
| | Autres valeurs mobilières | | 2 455 152 | 0,77 |
| | Obligations | | 2 455 152 | 0,77 |
| | <i>Islande</i> | | <i>1 498 545</i> | <i>0,47</i> |
| 1 500 000 | TEVA PHARMACEUTICAL F 4,500% 18-01/03/2025 | EUR | 1 498 545 | 0,47 |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>956 607</i> | <i>0,30</i> |
| 1 000 000 | UNITED GROUP BV 3,125% 20-15/02/2026 | EUR | 956 607 | 0,30 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 7 596 334 | 2,35 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>7 596 334</i> | <i>2,35</i> |
| 61 632,80 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 7 596 334 | 2,35 |
| | Total portefeuille-titres | | 314 469 290 | 97,78 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Inflation-Linked Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 181 740 696 | 97,96 |
| Obligations | | | 181 740 696 | 97,96 |
| <i>France</i> | | | <i>82 894 592</i> | <i>44,67</i> |
| 5 303 656 | FRANCE O.A.T. 0,100% 16-25/07/2047 | EUR | 4 679 849 | 2,52 |
| 7 508 658 | FRANCE O.A.T. 0,100% 17-01/03/2028 | EUR | 7 412 166 | 4,00 |
| 6 327 386 | FRANCE O.A.T. 0,100% 21-25/07/2031 | EUR | 6 239 537 | 3,36 |
| 4 258 437 | FRANCE O.A.T. 0,600% 23-25/07/2034 | EUR | 4 309 330 | 2,32 |
| 13 270 728 | FRANCE O.A.T. I/L 0,100% 22-25/07/2038 | EUR | 12 440 619 | 6,71 |
| 1 235 783 | FRANCE O.A.T. I/L 0,100% 22-25/07/2053 | EUR | 1 076 345 | 0,58 |
| 2 398 469 | FRANCE O.A.T. I/L 0,700% 14-25/07/2030 | EUR | 2 473 087 | 1,33 |
| 7 577 643 | FRANCE O.A.T. I/L 1,800% 07-25/07/2040 | EUR | 9 004 812 | 4,85 |
| 17 729 531 | FRANCE O.A.T. I/L 1,850% 11-25/07/2027 | EUR | 18 751 875 | 10,10 |
| 13 376 019 | FRANCE O.A.T. I/L 3,150% 02-25/07/2032 | EUR | 16 506 972 | 8,90 |
| <i>Italie</i> | | | <i>43 099 211</i> | <i>23,22</i> |
| 2 477 974 | ITALY BTPS 0,100% 22-15/05/2033 | EUR | 2 121 746 | 1,14 |
| 5 422 397 | ITALY BTPS 0,400% 19-15/05/2030 | EUR | 5 068 920 | 2,73 |
| 2 716 161 | ITALY BTPS 1,500% 23-15/05/2029 | EUR | 2 723 825 | 1,47 |
| 5 885 236 | ITALY BTPS 2,400% 23-15/05/2039 | EUR | 6 104 300 | 3,29 |
| 3 127 579 | ITALY BTPS I/L 0,150% 21-15/05/2051 | EUR | 1 984 508 | 1,07 |
| 15 774 705 | ITALY BTPS I/L 1,300% 17-15/05/2028 | EUR | 15 769 076 | 8,50 |
| 6 258 300 | ITALY BTPS I/L 2,550% 09-15/09/2041 | EUR | 6 705 933 | 3,61 |
| 2 485 247 | ITALY BTPS I/L 3,100% 11-15/09/2026 | EUR | 2 620 903 | 1,41 |
| <i>Allemagne</i> | | | <i>29 186 990</i> | <i>15,74</i> |
| 10 864 355 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND I/L 0,100% 15-15/04/2026 | EUR | 10 685 760 | 5,76 |
| 4 461 723 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND I/L 0,100% 15-15/04/2046 | EUR | 4 450 265 | 2,40 |
| 7 552 790 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND I/L 0,100% 21-15/04/2033 | EUR | 7 598 375 | 4,10 |
| 6 281 186 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND I/L 0,500% 14-15/04/2030 | EUR | 6 452 590 | 3,48 |
| <i>Espagne</i> | | | <i>21 720 879</i> | <i>11,71</i> |
| 6 055 989 | SPAIN I/L BOND 0,650% 17-30/11/2027 | EUR | 6 042 679 | 3,26 |
| 7 320 375 | SPAIN I/L BOND 0,700% 18-30/11/2033 | EUR | 7 083 009 | 3,82 |
| 7 344 800 | SPAIN I/L BOND 1,000% 15-30/11/2030 | EUR | 7 420 759 | 4,00 |
| 1 074 194 | SPAIN I/L BOND 2,050% 23-30/11/2039 | EUR | 1 174 432 | 0,63 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | <i>2 827 794</i> | <i>1,53</i> |
| 1 186 106 | UK TREASURY I/L GILT 0,625% 09-22/11/2042 | GBP | 1 330 927 | 0,72 |
| 1 546 219 | UK TREASURY I/L STOCK 0,125% 15-22/03/2046 | GBP | 1 496 867 | 0,81 |
| <i>Australie</i> | | | <i>1 011 869</i> | <i>0,55</i> |
| 1 359 000 | AUSTRALIAN GOVERNMENT 0,750% 17-21/11/2027 | AUD | 1 011 869 | 0,55 |
| <i>Luxembourg</i> | | | <i>999 361</i> | <i>0,54</i> |
| 1 000 000 | EIB 2,125% 14-15/01/2024 | EUR | 999 361 | 0,54 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 541 280 | 0,29 |
| <i>France</i> | | | <i>541 280</i> | <i>0,29</i> |
| 0,90 | BNP PARIBAS INVEST 3 MOIS - I - C | EUR | 541 280 | 0,29 |
| Total portefeuille-titres | | | 182 281 976 | 98,25 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Medium Term Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Obligations | | 223 173 117 | 85,81 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>46 786 854</i> | <i>18,02</i> | | | | | |
| 900 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 1,000% 22-23/05/2025 | EUR | 869 470 | 0,33 | 3 000 000 | UNEDIC 0,100% 20-25/11/2026 | EUR | 2 795 570 | 1,08 |
| 500 000 | BNP PARIBAS 1,000% 17-29/11/2024 | EUR | 485 499 | 0,19 | 600 000 | URW 4,125% 23-11/12/2030 | EUR | 617 476 | 0,24 |
| 300 000 | BOUYGUES SA 3,875% 23-17/07/2031 | EUR | 312 650 | 0,12 | 300 000 | VALEO SA 1,625% 16-18/03/2026 | EUR | 287 331 | 0,11 |
| 900 000 | BPCE 1,000% 19-01/04/2025 | EUR | 871 908 | 0,34 | <i>Italie</i> | | | | |
| 700 000 | BPCE SFH 3,375% 23-13/03/2029 | EUR | 719 515 | 0,28 | 1 100 000 | A2A SPA 1,500% 22-16/03/2028 | EUR | 1 029 174 | 0,40 |
| 300 000 | CAISSE FR DE FIN 3,625% 23-17/01/2029 | EUR | 312 002 | 0,12 | 900 000 | A2A SPA 2,500% 22-15/06/2026 | EUR | 883 272 | 0,34 |
| 600 000 | CAPGEMINI SE 1,625% 20-15/04/2026 | EUR | 580 627 | 0,22 | 322 000 | ACEA SPA 3,875% 23-24/01/2031 | EUR | 330 123 | 0,13 |
| 1 900 000 | CARMILA SA 1,625% 20-30/05/2027 | EUR | 1 752 088 | 0,67 | 836 000 | ACQUIRENTE UNI 2,800% 19-20/02/2026 | EUR | 818 736 | 0,31 |
| 900 000 | CARMILA SA 5,500% 23-09/10/2028 | EUR | 933 207 | 0,36 | 929 000 | BANCO BPM SPA 3,750% 23-27/06/2028 | EUR | 952 378 | 0,37 |
| 400 000 | CARREFOUR BANQUE 0,107% 21-14/06/2025 | EUR | 380 631 | 0,15 | 646 000 | BANCO BPM SPA 3,875% 23-18/09/2026 | EUR | 657 648 | 0,25 |
| 700 000 | CARREFOUR BANQUE 4,079% 23-05/05/2027 | EUR | 710 160 | 0,27 | 406 000 | BANCO BPM SPA 4,625% 23-29/11/2027 | EUR | 418 051 | 0,16 |
| 600 000 | CARREFOUR SA 2,625% 20-15/12/2027 | EUR | 587 784 | 0,23 | 700 000 | CREDIT AGRICOLE 3,500% 23-15/01/2030 | EUR | 713 998 | 0,27 |
| 1 200 000 | CIE DE ST GOBAIN 1,625% 22-10/08/2025 | EUR | 1 168 049 | 0,45 | 716 000 | ENI SPA 3,625% 23-19/05/2027 | EUR | 726 438 | 0,28 |
| 1 500 000 | COUNCIL OF EUROP 1,000% 22-13/04/2029 | EUR | 1 394 715 | 0,54 | 1 000 000 | HERA SPA 2,500% 22-25/05/2029 | EUR | 962 277 | 0,37 |
| 700 000 | CREDIT AGRICOLE HOME L 3,375% 23-04/09/2028 | EUR | 717 651 | 0,28 | 1 800 000 | INTESA SANPAOLO 2,125% 20-26/05/2025 | EUR | 1 763 284 | 0,68 |
| 900 000 | CREDIT AGRICOLE SA 1,000% 22-18/09/2025 | EUR | 868 521 | 0,33 | 1 161 000 | INTESA SANPAOLO 3,625% 23-30/06/2028 | EUR | 1 190 543 | 0,46 |
| 800 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 0,875% 20-07/05/2027 | EUR | 739 688 | 0,28 | 826 000 | INTESA SANPAOLO 4,000% 23-19/05/2026 | EUR | 837 508 | 0,32 |
| 900 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 1,625% 19-15/04/2026 | EUR | 865 030 | 0,33 | 1 000 000 | ITALGAS SPA 1,625% 17-19/01/2027 | EUR | 955 579 | 0,37 |
| 900 000 | CREDIT MUTUEL HOME 2,750% 22-08/12/2027 | EUR | 899 411 | 0,35 | 5 080 000 | ITALY BTPS 0,000% 21-01/04/2026 | EUR | 4 767 555 | 1,82 |
| 1 400 000 | DEXIA CREDIT LOCAL 0,010% 20-22/01/2027 | EUR | 1 294 352 | 0,50 | 1 000 | ITALY BTPS 0,350% 19-01/02/2025 | EUR | 969 | 0,00 |
| 2 900 000 | DEXIA CREDIT LOCAL 0,625% 19-17/01/2026 | EUR | 2 776 633 | 1,07 | 4 000 000 | ITALY BTPS 1,600% 16-01/06/2026 | EUR | 3 885 640 | 1,49 |
| 2 000 000 | DEXIA CREDIT LOCAL 1,250% 15-27/10/2025 | EUR | 1 943 562 | 0,75 | 114 000 | ITALY BTPS 1,850% 20-01/07/2025 | EUR | 111 976 | 0,04 |
| 300 000 | EDENRED 3,625% 23-13/12/2026 | EUR | 303 914 | 0,12 | 3 550 000 | ITALY BTPS 2,000% 18-01/02/2028 | EUR | 3 427 880 | 1,32 |
| 2 100 000 | ELEC DE FRANCE 3,750% 23-05/06/2027 | EUR | 2 140 456 | 0,82 | 890 000 | ITALY BTPS 2,800% 18-01/12/2028 | EUR | 882 088 | 0,34 |
| 1 100 000 | ENGIE 1,750% 20-27/03/2028 | EUR | 1 043 028 | 0,40 | 2 700 000 | ITALY BTPS 3,400% 23-28/03/2025 | EUR | 2 706 318 | 1,04 |
| 400 000 | ENGIE 3,625% 23-06/12/2026 | EUR | 405 535 | 0,16 | 4 000 000 | ITALY BTPS 3,800% 23-01/08/2028 | EUR | 4 134 840 | 1,59 |
| 3 100 000 | FRANCE O.A.T. 0,250% 16-25/11/2026 | EUR | 2 927 113 | 1,13 | 2 100 000 | ITALY BTPS 4,750% 13-01/09/2028 | EUR | 2 259 007 | 0,87 |
| 3 100 000 | FRANCE O.A.T. 0,750% 17-25/05/2028 | EUR | 2 910 962 | 1,12 | 1 000 000 | SNAM 3,375% 22-05/12/2026 | EUR | 1 007 275 | 0,39 |
| 1 000 000 | JCDECAUX SA 2,000% 20-24/10/2024 | EUR | 983 395 | 0,38 | 614 000 | SNAM 4,000% 23-27/11/2029 | EUR | 632 235 | 0,24 |
| 700 000 | JCDECAUX SE 5,000% 23-11/01/2029 | EUR | 735 185 | 0,28 | 1 100 000 | SNAM SPA 1,375% 17-25/10/2027 | EUR | 1 036 293 | 0,40 |
| 700 000 | LA POSTE SA 0,375% 19-17/09/2027 | EUR | 636 807 | 0,24 | <i>Espagne</i> | | | | |
| 400 000 | LEGRAND SA 3,500% 23-29/05/2029 | EUR | 413 038 | 0,16 | 700 000 | ARVAL SERVICE 3,375% 22-04/01/2026 | EUR | 698 749 | 0,27 |
| 800 000 | LOREAL SA 3,375% 23-23/01/2027 | EUR | 812 920 | 0,31 | 500 000 | BANCO SABADELL 3,500% 23-28/08/2026 | EUR | 506 389 | 0,19 |
| 900 000 | ORANGE 0,000% 19-04/09/2026 | EUR | 833 433 | 0,32 | 800 000 | BANCO SANTANDER 0,200% 21-11/02/2028 | EUR | 707 429 | 0,27 |
| 1 000 000 | ORANGE 0,000% 21-29/06/2026 | EUR | 930 516 | 0,36 | 400 000 | BANCO SANTANDER 3,250% 23-14/02/2028 | EUR | 406 253 | 0,16 |
| 900 000 | PERNOD RICARD SA 3,250% 22-02/11/2028 | EUR | 912 895 | 0,35 | 1 300 000 | BANCO SANTANDER 4,625% 07-04/05/2027 | EUR | 1 373 674 | 0,53 |
| 400 000 | PRAEMIA HEALTHCR 5,500% 23-19/09/2028 | EUR | 418 225 | 0,16 | 1 900 000 | BANKIA 1,000% 15-25/09/2025 | EUR | 1 829 817 | 0,70 |
| 100 000 | PSA BANQUE FRANC 3,875% 23-19/01/2026 | EUR | 100 665 | 0,04 | 900 000 | BANKINTER SA 3,050% 22-29/05/2028 | EUR | 903 511 | 0,35 |
| 256 000 | RCI BANQUE 0,500% 22-14/07/2025 | EUR | 244 248 | 0,09 | 600 000 | CAJA RURAL NAV 3,000% 23-26/04/2027 | EUR | 600 632 | 0,23 |
| 1 215 000 | RCI BANQUE 1,125% 20-15/01/2027 | EUR | 1 136 374 | 0,44 | 800 000 | CELLNEX FINANCE 1,000% 21-15/09/2027 | EUR | 731 838 | 0,28 |
| 369 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-02/10/2026 | EUR | 378 255 | 0,15 | 500 000 | FERROVIAL EMISIO 0,540% 20-12/11/2028 | EUR | 443 247 | 0,17 |
| 348 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-14/06/2028 | EUR | 365 770 | 0,14 | 1 000 000 | INSTIT CRDT OFCL 2,650% 22-31/01/2028 | EUR | 996 385 | 0,38 |
| 600 000 | RESEAU FERRE FRA 2,625% 14-29/12/2025 | EUR | 597 621 | 0,23 | 181 000 | INSTIT CRDT OFCL 3,050% 23-31/10/2027 | EUR | 183 312 | 0,07 |
| 500 000 | RTE RESEAU DE TR 3,500% 23-07/12/2031 | EUR | 515 702 | 0,20 | 1 000 000 | INSTIT CRDT OFCL 3,250% 23-31/10/2028 | EUR | 1 025 072 | 0,39 |
| 300 000 | SCHNEIDER ELEC 3,250% 23-12/06/2028 | EUR | 306 283 | 0,12 | 5 700 000 | KUTXABANK 1,250% 15-22/09/2025 | EUR | 5 520 504 | 2,11 |
| 900 000 | SFIL SA 0,000% 20-23/11/2028 | EUR | 793 030 | 0,30 | 1 500 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,000% 21-31/01/2028 | EUR | 1 355 880 | 0,52 |
| 1 000 000 | SUEZ 4,625% 22-03/11/2028 | EUR | 1 057 954 | 0,41 | 663 000 | SPANISH GOVERNMENT 0,800% 20-30/07/2027 | EUR | 624 566 | 0,24 |
| | | | | | 5 700 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,400% 18-30/04/2028 | EUR | 5 442 246 | 2,08 |
| | | | | | 2 400 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,450% 17-31/10/2027 | EUR | 2 308 536 | 0,89 |
| | | | | | 7 000 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,500% 17-30/04/2027 | EUR | 6 774 391 | 2,60 |
| | | | | | 1 300 000 | SPANISH GOVERNMENT 5,150% 13-31/10/2028 | EUR | 1 453 660 | 0,56 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Medium Term Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Pays-Bas | | 23 847 670 | 9,18 | | | | | |
| 800 000 | ABN AMRO BANK NV 2,375% 22-01/06/2027 | EUR | 778 310 | 0,30 | 827 000 | FRESENIUS MEDICA 3,875% 22-20/09/2027 | EUR | 839 094 | 0,32 |
| 400 000 | ABN AMRO BANK NV 3,750% 23-20/04/2025 | EUR | 401 378 | 0,15 | 308 000 | FRESENIUS SE & C 1,875% 22-24/05/2025 | EUR | 301 083 | 0,12 |
| 1 200 000 | ABN AMRO BANK NV 3,875% 23-21/12/2026 | EUR | 1 224 049 | 0,47 | 400 000 | INFINEON TECH 0,625% 22-17/02/2025 | EUR | 386 479 | 0,15 |
| 163 000 | AHOLD DELHAIZE 3,500% 23-04/04/2028 | EUR | 166 179 | 0,06 | 900 000 | SCHAEFFLER AG 1,875% 19-26/03/2024 | EUR | 889 783 | 0,34 |
| 261 000 | ALLIANDER 2,625% 22-09/09/2027 | EUR | 259 527 | 0,10 | 300 000 | SCHAEFFLER AG 2,750% 20-12/10/2025 | EUR | 293 872 | 0,11 |
| 258 000 | ALLIANDER 3,250% 23-13/06/2028 | EUR | 262 888 | 0,10 | 664 000 | UNICREDIT 0,010% 21-28/09/2026 | EUR | 616 312 | 0,24 |
| 193 000 | ASR NEDERLAND NV 3,625% 23-12/12/2028 | EUR | 195 529 | 0,08 | 402 000 | VOLKSWAGEN LEAS 4,500% 23-25/03/2026 | EUR | 410 399 | 0,16 |
| 700 000 | COOPERATIEVE RAB 3,296% 23-22/11/2028 | EUR | 721 330 | 0,28 | 1 300 000 | VONOVIA SE 0,000% 21-01/12/2025 | EUR | 1 211 749 | 0,47 |
| 400 000 | DAIMLER TRUCK 3,875% 23-19/06/2026 | EUR | 406 549 | 0,16 | 300 000 | VONOVIA SE 4,750% 22-23/05/2027 | EUR | 310 730 | 0,12 |
| 528 000 | DANFOSS FIN 1 BV 0,125% 21-28/04/2026 | EUR | 490 238 | 0,19 | | Irlande | | 8 884 781 | 3,41 |
| 369 000 | DIAGEO CAPITAL 1,500% 22-08/06/2029 | EUR | 343 039 | 0,13 | 320 000 | FCA BANK IE 0,000% 21-16/04/2024 | EUR | 316 443 | 0,12 |
| 913 000 | ENBW 3,625% 22-22/11/2026 | EUR | 928 378 | 0,36 | 7 990 000 | IRISH GOVERNMENT 0,200% 20-15/05/2027 | EUR | 7 486 152 | 2,87 |
| 1 300 000 | ENBW INTERNATIONAL FIN 4,875% 04-16/01/2025 | EUR | 1 316 255 | 0,51 | 1 100 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,875% 18-15/01/2026 | EUR | 1 082 186 | 0,42 |
| 1 254 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0,000% 21-28/05/2026 | EUR | 1 162 616 | 0,45 | | Corée du Sud | | 7 884 996 | 3,04 |
| 1 633 000 | HEIMSTADEN BOST 0,250% 21-13/10/2024 | EUR | 1 535 993 | 0,59 | 1 382 000 | KHFC 0,010% 21-29/06/2026 | EUR | 1 277 825 | 0,49 |
| 592 000 | HEIMSTADEN BOST 0,625% 22-24/07/2025 | EUR | 523 795 | 0,20 | 1 098 000 | KHFC 0,723% 22-22/03/2025 | EUR | 1 059 449 | 0,41 |
| 342 000 | HM FINANCE 4,875% 23-25/10/2031 | EUR | 365 027 | 0,14 | 746 000 | KHFC 4,082% 23-25/09/2027 | EUR | 770 685 | 0,30 |
| 1 298 000 | LEASEPLAN CORP 0,250% 21-07/09/2026 | EUR | 1 191 206 | 0,46 | 1 100 000 | KOOKMIN BANK 0,052% 20-15/07/2025 | EUR | 1 045 748 | 0,40 |
| 1 900 000 | LEASEPLAN CORP 3,500% 20-09/04/2025 | EUR | 1 897 527 | 0,73 | 1 000 000 | KOOKMIN BANK 2,375% 22-27/01/2026 | EUR | 983 780 | 0,38 |
| 601 000 | MERCEDES-BENZ IN 3,500% 23-30/05/2026 | EUR | 607 166 | 0,23 | 2 919 000 | REPUBLIC OF KOREA 0,000% 20-16/09/2025 | EUR | 2 747 509 | 1,06 |
| 1 100 000 | NETHERLANDS GOVERNMENT 2,500% 23-15/01/2030 | EUR | 1 120 955 | 0,43 | | Finlande | | 5 920 985 | 2,29 |
| 600 000 | NN BANK NV 3,625% 23-16/10/2026 | EUR | 612 370 | 0,24 | 2 500 000 | FINNISH GOVERNMENT 1,375% 22-15/04/2027 | EUR | 2 422 338 | 0,93 |
| 730 000 | PACCAR FINANCIAL 3,375% 23-15/05/2026 | EUR | 736 803 | 0,28 | 647 000 | FORTUM OYJ 4,000% 23-26/05/2028 | EUR | 663 439 | 0,26 |
| 1 500 000 | STEDIN HOLDING 0,875% 17-24/10/2025 | EUR | 1 436 245 | 0,55 | 336 000 | NOKIA OYJ 4,375% 23-21/08/2031 | EUR | 337 838 | 0,13 |
| 850 000 | STEDIN HOLDING 1,375% 18-19/09/2028 | EUR | 785 964 | 0,30 | 489 000 | NORDEA BANK ABP 1,125% 22-16/02/2027 | EUR | 459 160 | 0,18 |
| 500 000 | STELLANTIS NV 4,250% 23-16/06/2031 | EUR | 518 262 | 0,20 | 800 000 | NORDEA KIINNIT 2,625% 22-01/12/2025 | EUR | 795 963 | 0,31 |
| 310 000 | TENNET HLD BV 3,875% 22-28/10/2028 | EUR | 321 989 | 0,12 | 743 000 | NORDEA KIINNIT 3,500% 23-31/08/2026 | EUR | 757 140 | 0,29 |
| 601 000 | TOYOTA MOTOR FIN 0,000% 21-27/10/2025 | EUR | 567 164 | 0,22 | 480 000 | STORA ENSO OYJ 4,000% 23-01/06/2026 | EUR | 485 107 | 0,19 |
| 1 100 000 | VESTEDA FINANC 1,500% 19-24/05/2027 | EUR | 1 035 717 | 0,40 | | Etats-Unis d'Amérique | | 5 359 834 | 2,06 |
| 800 000 | VOLKSBANK NV 4,625% 23-23/11/2027 | EUR | 822 353 | 0,32 | 552 000 | BOOKING HLDS INC 0,100% 21-08/03/2025 | EUR | 530 432 | 0,20 |
| 1 000 000 | WINTERSHALL FIN 0,840% 19-25/09/2025 | EUR | 950 708 | 0,37 | 423 000 | BOOKING HLDS INC 3,625% 23-12/11/2028 | EUR | 434 531 | 0,17 |
| 162 000 | WOLTERS KLUWER N 3,000% 22-23/09/2026 | EUR | 162 161 | 0,06 | 517 000 | BOOKING HLDS INC 4,000% 22-15/11/2026 | EUR | 530 868 | 0,20 |
| | Belgique | | 12 398 358 | 4,77 | 701 000 | FORD MOTOR CREDIT 5,125% 23-20/02/2029 | EUR | 732 842 | 0,28 |
| 1 254 000 | AB INBEV SA/NV 2,125% 20-02/12/2027 | EUR | 1 220 208 | 0,47 | 1 410 000 | IBM CORP 3,375% 23-06/02/2027 | EUR | 1 426 449 | 0,55 |
| 1 400 000 | BELFIUS BANK SA 3,125% 16-11/05/2026 | EUR | 1 378 727 | 0,53 | 582 000 | MCDONALDS CORP 3,625% 23-28/11/2027 | EUR | 594 191 | 0,23 |
| 400 000 | BELFIUS BANK SA 3,875% 23-12/06/2028 | EUR | 409 196 | 0,16 | 468 000 | NATIONAL GRID NA INC 0,410% 22-20/01/2026 | EUR | 441 125 | 0,17 |
| 3 000 000 | BELGIUM GOVERNMENT 0,000% 20-22/10/2027 | EUR | 2 759 250 | 1,06 | 652 000 | NATIONAL GRID NA INC 4,151% 23-12/09/2027 | EUR | 669 396 | 0,26 |
| 4 300 000 | BELGIUM GOVERNMENT 0,800% 17-22/06/2027 | EUR | 4 093 880 | 1,57 | | Canada | | 4 207 395 | 1,61 |
| 1 000 000 | ELIA SYSTEM OP 1,375% 19-14/01/2026 | EUR | 960 976 | 0,37 | 800 000 | BANK OF MONTREAL 3,375% 23-04/07/2026 | EUR | 807 528 | 0,31 |
| 1 600 000 | EUROPEAN UNION 2,000% 22-04/10/2027 | EUR | 1 576 121 | 0,61 | 883 000 | CAN IMPERIAL BK 0,375% 22-10/03/2026 | EUR | 833 295 | 0,32 |
| | Allemagne | | 11 391 064 | 4,38 | 800 000 | CAN IMPERIAL BK 3,250% 23-31/03/2027 | EUR | 806 894 | 0,31 |
| 1 000 000 | BAYERISCHE LNDKB 4,250% 23-21/06/2027 | EUR | 1 023 010 | 0,39 | 882 000 | ROYAL BANK OF CANADA 2,375% 22-13/09/2027 | EUR | 866 345 | 0,33 |
| 1 840 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 187 2,200% 23-13/04/2028 | EUR | 1 857 180 | 0,71 | 889 000 | TORONTO DOMINION BANK 3,250% 22-27/04/2026 | EUR | 893 333 | 0,34 |
| 2 600 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 188 2,400% 23-19/10/2028 | EUR | 2 653 898 | 1,02 | | Suède | | 4 085 169 | 1,58 |
| 578 000 | E.ON SE 3,750% 23-01/03/2029 | EUR | 597 475 | 0,23 | 700 000 | SBAB BANK AB 1,875% 22-10/12/2025 | EUR | 679 676 | 0,26 |
| | | | | | 772 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 0,750% 22-09/08/2027 | EUR | 701 711 | 0,27 |
| | | | | | 955 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 4,125% 23-29/06/2027 | EUR | 982 974 | 0,38 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Medium Term Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|---|--------------------------------|---------------------|-------------------|------|
| 991 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 0,125% 21-03/11/2026 | EUR | 910 483 | 0,35 | 1 500 000 | ITALY CCTS EU 20-15/04/2026 FRN | EUR | 1 506 975 | 0,58 | |
| 361 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 2,625% 22-05/09/2029 | EUR | 352 181 | 0,14 | 622 000 | MEDIOBANCA SPA 22-07/02/2029 FRN | EUR | 646 587 | 0,25 | |
| 298 000 | VOLVO TREAS AB 2,000% 22-19/08/2027 | EUR | 287 504 | 0,11 | 483 000 | MEDIOBANCA SPA 23-13/09/2027 FRN | EUR | 496 501 | 0,19 | |
| 170 000 | VOLVO TREAS AB 3,500% 23-17/11/2025 | EUR | 170 640 | 0,07 | 1 192 000 | UNICREDIT SPA 23-14/02/2030 FRN | EUR | 1 243 099 | 0,48 | |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>3 224 428</i> | <i>1,24</i> | | <i>Espagne</i> | | <i>5 593 896</i> | <i>2,15</i> | |
| 1 500 000 | ESM 1,000% 22-23/06/2027 | EUR | 1 428 719 | 0,55 | 1 100 000 | BANCO SANTANDER 23-18/10/2027 FRN | EUR | 1 126 683 | 0,43 | |
| 1 867 000 | LUXEMBOURG GOVERNMENT 0,000% 20-28/04/2025 | EUR | 1 795 709 | 0,69 | 1 200 000 | CAIXABANK 20-18/11/2026 FRN | EUR | 1 129 237 | 0,43 | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>3 042 190</i> | <i>1,17</i> | 900 000 | CAIXABANK 21-26/05/2028 FRN | EUR | 819 534 | 0,32 | |
| 692 000 | DNB BOLIGKREDIT 3,375% 23-14/11/2028 | EUR | 711 597 | 0,27 | 1 100 000 | CAIXABANK 22-13/04/2026 FRN | EUR | 1 070 153 | 0,41 | |
| 891 000 | SPAREBANK 1 SR 4,875% 23-24/08/2028 | EUR | 937 693 | 0,36 | 600 000 | CAIXABANK 23-16/05/2027 FRN | EUR | 612 147 | 0,24 | |
| 1 400 000 | STATOIL ASA 2,875% 13-10/09/2025 | EUR | 1 392 900 | 0,54 | 800 000 | CAIXABANK 23-19/07/2029 FRN | EUR | 836 142 | 0,32 | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>2 725 246</i> | <i>1,05</i> | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>2 906 470</i> | <i>1,13</i> | |
| 166 000 | ANZ NZ INTL/LDN 3,951% 23-17/07/2026 | EUR | 169 903 | 0,07 | 200 000 | ABN AMRO BANK NV 23-10/01/2025 FRN | EUR | 200 369 | 0,08 | |
| 614 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 631 566 | 0,24 | 800 000 | COOPERATIEVE RAB 22-27/01/2028 FRN | EUR | 827 951 | 0,32 | |
| 247 000 | LLOYDS BANK PLC 3,250% 23-02/02/2026 | EUR | 248 111 | 0,10 | 1 100 000 | COOPERATIEVE RAB 23-03/11/2026 FRN | EUR | 1 106 522 | 0,43 | |
| 1 000 000 | NATIONWIDE BLDG 3,375% 23-27/11/2028 | EUR | 1 024 047 | 0,39 | 800 000 | VOLKSBANK NV 22-04/05/2027 FRN | EUR | 771 628 | 0,30 | |
| 511 000 | SAGE GROUP 3,820% 23-15/02/2028 | EUR | 525 101 | 0,20 | | <i>Irlande</i> | | <i>2 104 986</i> | <i>0,81</i> | |
| 128 000 | SSE PLC 2,875% 22-01/08/2029 | EUR | 126 518 | 0,05 | 672 000 | AIB GROUP PLC 22-04/04/2028 FRN | EUR | 643 680 | 0,25 | |
| | <i>Australie</i> | | <i>2 397 364</i> | <i>0,92</i> | 612 000 | BANK OF IRELAND 22-05/06/2026 FRN | EUR | 595 023 | 0,23 | |
| 708 000 | AUST & NZ BANK 0,250% 22-17/03/2025 | EUR | 682 160 | 0,26 | 812 000 | BANK OF IRELAND 23-04/07/2031 FRN | EUR | 866 283 | 0,33 | |
| 600 000 | COM BK AUSTRALIA 3,246% 22-24/10/2025 | EUR | 601 184 | 0,23 | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>1 875 662</i> | <i>0,72</i> | |
| 800 000 | NATL AUSTRALIABK 3,263% 23-13/02/2026 | EUR | 803 437 | 0,31 | 600 000 | BANK OF AMERICA CORP 21-24/08/2025 FRN | EUR | 602 498 | 0,23 | |
| 322 000 | TOYOTA FIN AUSTR 0,064% 22-13/01/2025 | EUR | 310 583 | 0,12 | 698 000 | BANK OF AMERICA CORP 22-27/10/2026 FRN | EUR | 677 858 | 0,26 | |
| | <i>Portugal</i> | | <i>2 037 531</i> | <i>0,78</i> | 587 000 | CITIGROUP INC 22-22/09/2028 FRN | EUR | 595 306 | 0,23 | |
| 900 000 | BANCO SANTOTTA 3,750% 23-11/09/2026 | EUR | 915 650 | 0,35 | | <i>France</i> | | <i>1 766 286</i> | <i>0,68</i> | |
| 800 000 | BANCO SANTANDER TOTTA 3,375% 23-19/04/2028 | EUR | 813 635 | 0,31 | 900 000 | CREDIT AGRICOLE SA 22-12/10/2026 FRN | EUR | 906 956 | 0,35 | |
| 300 000 | EDP SA 3,875% 23-26/06/2028 | EUR | 308 246 | 0,12 | 900 000 | LA BANQUE POSTALE 20-17/06/2026 FRN | EUR | 859 330 | 0,33 | |
| | <i>Japon</i> | | <i>1 650 846</i> | <i>0,63</i> | | <i>Norvège</i> | | <i>1 129 932</i> | <i>0,43</i> | |
| 1 066 000 | MIZUHO FINANCIAL 0,184% 21-13/04/2026 | EUR | 993 790 | 0,38 | 586 000 | DNB BANK ASA 22-21/09/2027 FRN | EUR | 583 645 | 0,22 | |
| 698 000 | NTT FINANCE 0,082% 21-13/12/2025 | EUR | 657 056 | 0,25 | 520 000 | DNB BANK ASA 23-01/11/2029 FRN | EUR | 546 287 | 0,21 | |
| | <i>Danemark</i> | | <i>1 493 115</i> | <i>0,57</i> | | <i>Canada</i> | | <i>716 434</i> | <i>0,28</i> | |
| 418 000 | ORSTED A/S 2,250% 22-14/06/2028 | EUR | 401 335 | 0,15 | 715 000 | TORONTO DOMINION BANK 23-21/07/2025 FRN | EUR | 716 434 | 0,28 | |
| 655 000 | ORSTED A/S 3,625% 23-01/03/2026 | EUR | 657 455 | 0,25 | | <i>Belgique</i> | | <i>707 201</i> | <i>0,27</i> | |
| 419 000 | PANDORA A/S 4,500% 23-10/04/2028 | EUR | 434 325 | 0,17 | 700 000 | KBC GROUP NV 23-06/06/2026 FRN | EUR | 707 201 | 0,27 | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>1 492 340</i> | <i>0,57</i> | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>668 737</i> | <i>0,26</i> | |
| 1 600 000 | ZUERCHER KBK 0,000% 21-15/05/2026 | EUR | 1 492 340 | 0,57 | 674 000 | SANTANDER UK GRP 22-25/08/2028 FRN | EUR | 668 737 | 0,26 | |
| | <i>Autriche</i> | | <i>1 356 354</i> | <i>0,52</i> | | <i>Suède</i> | | <i>308 047</i> | <i>0,12</i> | |
| 600 000 | UNICREDIT BK AUS 1,500% 22-24/05/2028 | EUR | 568 317 | 0,22 | 309 000 | NORDEA BANK AB 23-10/02/2026 FRN | EUR | 308 047 | 0,12 | |
| 800 000 | UNICREDIT BK AUS 2,375% 22-20/09/2027 | EUR | 788 037 | 0,30 | | <i>Autres valeurs mobilières</i> | | <i>3 318 902</i> | <i>1,28</i> | |
| | <i>Nouvelle-Zélande</i> | | <i>1 030 501</i> | <i>0,40</i> | | <i>Obligations</i> | | <i>3 318 902</i> | <i>1,28</i> | |
| 1 000 000 | BANK NEW ZEALAND 3,708% 23-20/12/2028 | EUR | 1 030 501 | 0,40 | | <i>France</i> | | <i>3 318 902</i> | <i>1,28</i> | |
| | <i>Roumanie</i> | | <i>978 920</i> | <i>0,38</i> | 3 430 000 | FRANCE O.A.T. 21 25 0,000% 25/02/2025 | EUR | 3 318 902 | 1,28 | |
| 1 000 000 | ROMANIA 2,750% 20-26/02/2026 | EUR | 978 920 | 0,38 | | <i>Actions/Parts de fonds d'investissements</i> | | <i>4 503 954</i> | <i>1,72</i> | |
| | Obligations à taux flottant | | 24 413 066 | 9,41 | | <i>France</i> | | <i>4 503 954</i> | <i>1,72</i> | |
| | <i>Italie</i> | | <i>6 635 415</i> | <i>2,56</i> | | 3 981,44 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 4 503 954 | 1,72 |
| 768 000 | INTESA SANPAOLO 23-08/03/2028 FRN | EUR | 794 234 | 0,31 | | Total portefeuille-titres | | 255 409 039 | 98,22 | |
| 1 000 000 | INTESA SANPAOLO 23-16/11/2025 FRN | EUR | 1 001 980 | 0,39 | | | | | | |
| 945 000 | INTESA SANPAOLO 23-17/03/2025 FRN | EUR | 946 039 | 0,36 | | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Money Market

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|----------------------|-------------------|---|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations à taux flottant | | | 59 220 420 | 2,72 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 5 000 000 | HSBC CON EUROPE 22-28/06/2024 FRN | EUR | 5 016 050 | 0,23 | 15 000 000 | EIFFAGE SA 0,000% 23/02/2024 NEUCP | EUR | 14 905 379 | 0,69 |
| 20 000 000 | SOCIETE GENERALE SA 23-19/05/2025 FRN | EUR | 20 019 560 | 0,92 | 5 000 000 | FONCIERE LYONNAISE (SOCIETE) 0,000% 17/01/2024 | EUR | 4 989 283 | 0,23 |
| <i>Australie</i> | | | | | | | | | |
| 10 000 000 | MACQUARIE BK LIMITED 23-20/10/2025 FRN | EUR | 10 015 272 | 0,46 | 15 000 000 | FORVIA SE 0,000% 02/07/2024 NEUCP | EUR | 14 675 409 | 0,68 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 4 000 000 | LLOYDS BANK 22-12/08/2024 FRN | EUR | 4 002 880 | 0,18 | 10 000 000 | LAGARDERE SA 0,000% 09/05/2024 NEUCP | EUR | 9 846 838 | 0,45 |
| 2 535 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 23-07/06/2025 FRN | EUR | 2 540 324 | 0,12 | 20 000 000 | OCEAN(CAISSE FEDERALE DU CREDIT MUTUEL) 4,139% 21/08/2024 | EUR | 20 002 594 | 0,92 |
| 3 200 000 | NATWEST MARKETS NV 23-18/09/2025 FRN | EUR | 3 201 312 | 0,15 | 9 500 000 | PR FINANCE S.A. 0,000% 17/01/2024 NEUCP | EUR | 9 479 638 | 0,44 |
| <i>Espagne</i> | | | | | | | | | |
| 7 800 000 | BANCO SANTANDER 23-16/01/2025 FRN | EUR | 7 819 032 | 0,36 | 20 000 000 | PSA BANQUE FRANCE SA ESTERCAP+0,37 3,470% 09/04/2024 | EUR | 20 009 906 | 0,92 |
| <i>Suède</i> | | | | | | | | | |
| 1 600 000 | VOLVO TREAS AB 22-11/01/2024 FRN | EUR | 1 600 160 | 0,07 | 10 000 000 | RCI BANQUE SA 0,000% 11/01/2024 NEUCP | EUR | 9 985 325 | 0,46 |
| 2 000 000 | VOLVO TREAS AB 23-30/03/2025 FRN | EUR | 2 002 680 | 0,09 | 5 000 000 | SCHNEIDER ELECTRIC SE 0,000% 29/01/2024 NEUCP | EUR | 4 982 537 | 0,23 |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | | | | | |
| 3 000 000 | TOYOTA MOTOR FIN 23-31/08/2025 FRN | EUR | 3 003 150 | 0,14 | 20 000 000 | SOCIETE GENERALE SA ESTERCAP+0,32 4,221% 02/09/2024 | EUR | 20 003 095 | 0,92 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| Autres valeurs mobilières | | | | | | | | | |
| Obligations à taux flottant | | | 30 002 487 | 1,38 | 20 000 000 | SOCIETE GENERALE SA ESTERCAP+0,33 4,233% 31/10/2024 | EUR | 19 997 568 | 0,92 |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 15 000 000 | CREDIT LYONNAIS SA ESTERCAP+0,64 20/06/2025 FRN | EUR | 14 995 500 | 0,69 | 10 000 000 | VALEO SA 0,000% 12/06/2024 NEUCP | EUR | 9 810 588 | 0,45 |
| 15 000 000 | SOCIETE GENERALE SA ESTERCAP +0,38 12/03/2024 FRN | EUR | 15 006 987 | 0,69 | 23 000 000 | VICAT SA 0,000% 02/05/2024 NEUCP | EUR | 22 665 371 | 1,05 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| Instruments du marché monétaire | | | 1 823 022 341 | 84,12 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 3 000 000 | ACCOR SA 0,000% 29/02/2024 NEUCP | EUR | 2 978 103 | 0,14 | <i>Barclays Bank PLC</i> | | | | |
| 5 000 000 | ARVAL SERVICE LEASE FRANCE 0,000% 23/02/2024 | EUR | 4 968 460 | 0,23 | 20 000 000 | BARCLAYS BANK PLC ESTERCAP +0,38 3,532% 13/05/2024 | EUR | 20 013 940 | 0,92 |
| 7 000 000 | ARVAL SERVICE LEASE FRANCE 0,000% 30/05/2024 | EUR | 6 882 758 | 0,32 | 20 000 000 | BARCLAYS BANK PLC ESTERCAP +0,38 3,532% 16/05/2024 | EUR | 20 014 059 | 0,92 |
| 10 000 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA ES 3,464% 02/04/2024 | EUR | 10 004 990 | 0,46 | 25 000 000 | BARCLAYS BANK PLC ESTERCAP+0,4 4,251% 21/08/2024 | EUR | 25 018 211 | 1,15 |
| 20 000 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA ES 4,147% 04/07/2024 | EUR | 20 004 814 | 0,92 | 25 000 000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0,000% 22/04/2024 | EUR | 24 685 224 | 1,14 |
| 10 000 000 | BANQUE PALATINE SA ESTERCAP+0,34 4,246% 29/08/2024 | EUR | 10 001 768 | 0,46 | 25 000 000 | MUFJ BANK LTD 0,000% 28/03/2024 | EUR | 24 751 348 | 1,14 |
| 15 000 000 | BPE ESTERCAP+0,34 4,254% 26/09/2024 NEUCP | EUR | 15 000 197 | 0,69 | 20 000 000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK (GB) LIMITED 0,000% 03/01/2024 | EUR | 19 988 986 | 0,92 |
| 20 000 000 | BRED BANQUE POPULAIRE ESTERCAP+0,105 3,981% 05/01/2024 | EUR | 19 999 983 | 0,92 | 12 000 000 | NATIONAL BANK OF CANADA LONDON 0,000% 12/11/2024 | EUR | 11 624 694 | 0,54 |
| 10 000 000 | CDC HABITAT 0,000% 26/02/2024 NEUCP | EUR | 9 934 608 | 0,46 | 20 000 000 | NOMURA BANK INTERNATIONAL PLC 0,000% 23/08/2024 | EUR | 19 503 158 | 0,90 |
| 5 000 000 | COFACE SA 0,000% 23/07/2024 NEUCP | EUR | 4 889 932 | 0,23 | 4 500 000 | NORDEA BANK ABP, LONDON BRANCH 0,000% 13/03/2024 | EUR | 4 462 954 | 0,21 |
| 6 000 000 | COVIVIO HOTELS SACA 0,000% 23/02/2024 NEUCP | EUR | 5 962 152 | 0,28 | 25 000 000 | NORDEA BANK ABP, LONDON BRANCH 0,000% 31/05/2024 | EUR | 24 591 933 | 1,13 |
| 10 000 000 | CREDIT AGRICOLE SA ESTERCAP+0,32 4,134% 21/08/2024 | EUR | 10 001 126 | 0,46 | 10 000 000 | STANDARD CHARTERED BANK 0,000% 15/04/2024 | EUR | 9 881 445 | 0,46 |
| 5 000 000 | COMMERCIAL ESTERCAP 3,352% 02/04/2024 | EUR | 5 002 495 | 0,23 | 10 000 000 | STANDARD CHARTERED BANK 0,000% 26/07/2024 | EUR | 9 779 998 | 0,45 |
| 10 000 000 | COMMERCIAL ESTERCAP 3,354% 04/04/2024 | EUR | 10 005 035 | 0,46 | 10 000 000 | STANDARD CHARTERED BANK ESTERCAP+0,37 4,279% 23/10/2024 | EUR | 10 002 701 | 0,46 |
| 10 000 000 | CREDIT LYONNAIS SA ESTERCAP +0,36 3,508% 28/05/2024 | EUR | 10 005 453 | 0,46 | 10 000 000 | TORONTO DOMINION BANK (LONDON) +0,35 4,138% 16/07/2024 | EUR | 10 008 471 | 0,46 |
| 20 000 000 | CREDIT LYONNAIS SA ESTERCAP+0,3 4,206% 04/10/2024 | EUR | 19 993 230 | 0,92 | 20 000 000 | TORONTO DOMINION BANK (LONDON) +0,35 4,259% 25/10/2024 | EUR | 20 002 078 | 0,92 |
| 20 000 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA ESTERCAP+0,32 4,120% 12/08/2024 | EUR | 20 002 604 | 0,92 | 10 000 000 | TORONTO DOMINION BANK (LONDON) 0,000% 02/04/2024 | EUR | 9 896 281 | 0,46 |
| 25 000 000 | EIFFAGE SA 0,000% 05/12/2024 NEUCP | EUR | 24 161 679 | 1,11 | 10 000 000 | TORONTO DOMINION BANK (LONDON) 0,000% 12/09/2024 | EUR | 9 738 465 | 0,45 |
| 16 000 000 | EIFFAGE SA 0,000% 11/03/2024 NEUCP | EUR | 15 868 787 | 0,73 | 25 000 000 | UBS AG/LONDON 0,000% 14/11/2024 | EUR | 24 214 130 | 1,12 |
| | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| | | | | | 241 982 630 11,17 | | | | |
| | | | | | 15 000 000 ACHMEA BANK NV 0,000% 13/05/2024 NEUCP | | | | |
| | | | | | 13 000 000 ACHMEA BANK NV 0,000% 22/05/2024 NEUCP | | | | |
| | | | | | 10 000 000 ACHMEA HYPOTHEEK BANK 0,000% 21/06/2024 NEUCP | | | | |
| | | | | | 15 000 000 AMERICA MOVIL BV 0,000% 28/03/2024 | | | | |
| | | | | | 24 000 000 ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0,000% 31/01/2024 | | | | |
| | | | | | 15 000 000 ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0,000% 31/01/2024 | | | | |
| | | | | | 10 000 000 FERROVIAL SE 0,000% 05/02/2024 | | | | |
| | | | | | 15 000 000 ING BANK NV ESTERCAP +0,51 3,457% 15/03/2024 NEUCP | | | | |
| | | | | | 10 000 000 ING BANK NV ESTERCAP+0,32 4,234% 26/09/2024 CP | | | | |
| | | | | | 30 000 000 ING BANK NV ESTERCAP+0,33 4,243% 07/10/2024 CP | | | | |
| | | | | | 20 000 000 ING BANK NV ESTERCAP+0,395 3,632% 31/05/2024 NEUCP | | | | |
| | | | | | 7 500 000 KONINKLIJKE KPN NV 0,000% 23/01/2024 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Money Market

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| 20 000 000 | NATWEST MARKETS NV 0,000% 08/10/2024 | EUR | 19 431 645 | 0,90 | | | | | |
| 10 000 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 0,000% 11/04/2024 | EUR | 9 884 060 | 0,46 | | | | | |
| 10 000 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 0,000% 13/08/2024 | EUR | 9 760 902 | 0,45 | | | | | |
| 20 000 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 0,000% 18/11/2024 | EUR | 19 356 432 | 0,89 | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>145 068 116</i> | <i>6,68</i> | | | | | |
| 10 000 000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0,000% 15/02/2024 | EUR | 9 945 927 | 0,46 | | | | | |
| 10 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG S.A. 0,000% 07/05/2024 | EUR | 9 856 122 | 0,45 | | | | | |
| 15 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG S.A. 0,000% 24/01/2024 | EUR | 14 956 493 | 0,69 | | | | | |
| 12 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG S.A. 0,000% 27/09/2024 | EUR | 11 662 154 | 0,54 | | | | | |
| 25 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG S.A. 0,000% 29/01/2024 | EUR | 24 913 568 | 1,15 | | | | | |
| 25 000 000 | MEDIOBANCA INTERNATIONAL LUXEMBOURG SA 0,000% 29/08/2024 | EUR | 24 365 596 | 1,12 | | | | | |
| 25 000 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 0,000% 03/06/2024 | EUR | 24 571 195 | 1,13 | | | | | |
| 10 000 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 0,000% 08/01/2024 | EUR | 9 988 708 | 0,46 | | | | | |
| 15 000 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 0,000% 22/04/2024 | EUR | 14 808 353 | 0,68 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>128 292 096</i> | <i>5,93</i> | | | | | |
| 6 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0,000% 02/12/2024 | EUR | 5 802 904 | 0,27 | | | | | |
| 10 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0,000% 04/10/2024 | EUR | 9 719 174 | 0,45 | | | | | |
| 10 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0,000% 23/05/2024 | EUR | 9 842 144 | 0,45 | | | | | |
| 30 000 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 0,000% 30/04/2024 | EUR | 29 597 231 | 1,38 | | | | | |
| 10 000 000 | BANCO SANTANDER SA 0,000% 02/09/2024 | EUR | 9 745 231 | 0,45 | | | | | |
| 10 000 000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0,000% 10/06/2024 | EUR | 9 822 835 | 0,45 | | | | | |
| 15 000 000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0,000% 14/10/2024 | EUR | 14 558 993 | 0,67 | | | | | |
| 10 000 000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0,000% 24/06/2024 | EUR | 9 809 073 | 0,45 | | | | | |
| 20 000 000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0,000% 25/06/2024 | EUR | 19 616 195 | 0,91 | | | | | |
| 10 000 000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0,000% 26/07/2024 | EUR | 9 778 316 | 0,45 | | | | | |
| | <i>Suède</i> | | <i>91 429 189</i> | <i>4,22</i> | | | | | |
| 15 000 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB (PUBL) 0,000% 04/11/2024 | EUR | 14 545 747 | 0,67 | | | | | |
| 3 500 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0,000% 03/10/2024 | EUR | 3 403 223 | 0,16 | | | | | |
| 15 000 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0,000% 07/05/2024 | EUR | 14 791 179 | 0,68 | | | | | |
| 20 000 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0,000% 31/05/2024 | EUR | 19 673 547 | 0,91 | | | | | |
| 25 000 000 | SWEDBANK AB 0,000% 11/10/2024 | EUR | 24 283 302 | 1,12 | | | | | |
| 15 000 000 | VATTENFALL AB 0,000% 10/06/2024 | EUR | 14 732 191 | 0,68 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>89 621 472</i> | <i>4,13</i> | | | | | |
| 25 000 000 | CA AUTO BANK S.P.A. 0,000% 11/01/2024 | EUR | 24 963 691 | 1,15 | | | | | |
| 15 000 000 | ENI SPA 0,000% 17/01/2024 | EUR | 14 967 850 | 0,69 | | | | | |
| 10 000 000 | SNAM SPA 0,000% 04/03/2024 | EUR | 9 925 755 | 0,46 | | | | | |
| 20 000 000 | SNAM SPA 0,000% 19/03/2024 | EUR | 19 818 293 | 0,91 | | | | | |
| 20 000 000 | SNAM SPA 0,000% 22/01/2024 | EUR | 19 945 883 | 0,92 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>78 465 171</i> | <i>3,63</i> | | | | | |
| 10 000 000 | SANTANDER CONSUMER BANK AG 0,000% 27/08/2024 | EUR | 9 748 533 | 0,45 | | | | | |
| 10 000 000 | STANDARD CHARTERED BANK AG 0,000% 05/02/2024 | EUR | 9 957 901 | 0,46 | | | | | |
| 10 000 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0,000% 15/07/2024 | EUR | 9 787 565 | 0,45 | | | | | |
| 20 000 000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0,000% 14/06/2024 | EUR | 19 634 947 | 0,91 | | | | | |
| 15 000 000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0,000% 18/07/2024 | EUR | 14 677 137 | 0,68 | | | | | |
| 15 000 000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0,000% 31/07/2024 | EUR | 14 659 088 | 0,68 | | | | | |
| | <i>Australie</i> | | | | | | | <i>73 728 860</i> | <i>3,41</i> |
| 15 000 000 | AUSTRALIA + NEW ZEALAND BANKING GROUP LT 0,000% 24/10/2024 | EUR | 14 559 147 | 0,67 | | | | | |
| 10 000 000 | MACQUARIE BANK LIMITED 0,000% 04/10/2024 | EUR | 9 719 174 | 0,45 | | | | | |
| 20 000 000 | MACQUARIE BANK LIMITED 0,000% 11/10/2024 | EUR | 19 426 642 | 0,90 | | | | | |
| 6 000 000 | MACQUARIE BANK LIMITED 0,000% 13/11/2024 | EUR | 5 811 869 | 0,27 | | | | | |
| 15 000 000 | MACQUARIE BANK LIMITED 0,000% 28/10/2024 | EUR | 14 548 995 | 0,67 | | | | | |
| 10 000 000 | MACQUARIE BANK LTD 0,000% 13/12/2024 | EUR | 9 663 033 | 0,45 | | | | | |
| | <i>Danemark</i> | | | | | | | <i>73 340 173</i> | <i>3,39</i> |
| 35 000 000 | DANSKE BANK A/S 0,000% 03/10/2024 | EUR | 34 019 933 | 1,58 | | | | | |
| 10 000 000 | DANSKE BANK A/S 0,000% 04/07/2024 | EUR | 9 800 331 | 0,45 | | | | | |
| 25 000 000 | DANSKE BANK A/S 0,000% 27/06/2024 | EUR | 24 517 398 | 1,13 | | | | | |
| 5 000 000 | JYSKE BANK A/S ESTERCAP+0,35 4,102% 02/07/2024 | EUR | 5 002 511 | 0,23 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | | | | | | <i>62 834 018</i> | <i>2,91</i> |
| 5 000 000 | HEWLETT - PACKARD INTERNATIONAL BANK PLC 0,000% 15/02/2024 | EUR | 4 973 156 | 0,23 | | | | | |
| 1 000 000 | HEWLETT - PACKARD INTERNATIONAL BANK PLC 0,000% 22/02/2024 | EUR | 993 841 | 0,05 | | | | | |
| 10 000 000 | HEWLETT - PACKARD INTERNATIONAL BANK PLC 0,000% 23/01/2024 | EUR | 9 972 108 | 0,46 | | | | | |
| 7 500 000 | HEWLETT - PACKARD INTERNATIONAL BANK PLC 0,000% 27/02/2024 | EUR | 7 449 566 | 0,34 | | | | | |
| 10 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0,000% 22/04/2024 | EUR | 9 872 178 | 0,46 | | | | | |
| 15 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0,000% 24/06/2024 | EUR | 14 709 449 | 0,68 | | | | | |
| 15 000 000 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC 0,000% 19/03/2024 | EUR | 14 863 720 | 0,69 | | | | | |
| | <i>Norvège</i> | | | | | | | <i>44 555 894</i> | <i>2,06</i> |
| 15 000 000 | DNB BANK ASA 0,000% 05/11/2024 | EUR | 14 544 538 | 0,67 | | | | | |
| 30 000 000 | DNB BANK ASA ESTERCAP+0,35 4,257% 06/11/2024 CD | EUR | 30 011 356 | 1,39 | | | | | |
| | <i>Finlande</i> | | | | | | | <i>29 153 117</i> | <i>1,35</i> |
| 20 000 000 | OP CORPORATE BANK PLC 0,000% 09/09/2024 | EUR | 19 486 800 | 0,90 | | | | | |
| 10 000 000 | OP CORPORATE BANK PLC 0,000% 11/12/2024 | EUR | 9 666 317 | 0,45 | | | | | |
| | <i>Belgique</i> | | | | | | | <i>19 950 729</i> | <i>0,92</i> |
| 20 000 000 | BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 0,000% 19/01/2024 | EUR | 19 950 729 | 0,92 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | <i>9 993 358</i> | <i>0,46</i> |
| 10 000 000 | COLGATE PALMOLIVE CO 0,000% 04/01/2024 | EUR | 9 993 358 | 0,46 | | | | | |
| | <i>Canada</i> | | | | | | | <i>9 819 239</i> | <i>0,45</i> |
| 10 000 000 | TORONTO DOMINION BANK (LONDON) 0,000% 18/06/2024 | EUR | 9 819 239 | 0,45 | | | | | |
| | <i>Ile de Jersey</i> | | | | | | | <i>9 779 566</i> | <i>0,45</i> |
| 10 000 000 | ROYAL BANK OF SCOTLAND INTERNATIONAL 0,000% 23/07/2024 | EUR | 9 779 566 | 0,45 | | | | | |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | | | | 61 362 866 | 2,84 |
| | <i>France</i> | | | | | | | <i>61 362 866</i> | <i>2,84</i> |
| 46,14 | BNP PARIBAS CASH INVEST - I PLUS CAP | EUR | 46 982 139 | 2,18 | | | | | |
| 267,00 | BNP PARIBAS MONE ETAT I | EUR | 14 380 727 | 0,66 | | | | | |
| | Total portefeuille-titres | | | | | | | 1 973 608 114 | 91,06 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Short Term Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Obligations | | 222 988 610 | 59,63 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>69 878 349</i> | <i>18,67</i> | | | | | |
| 3 700 000 | AIR FRANCE-KLM 7,250% 23-31/05/2026 | EUR | 3 942 108 | 1,04 | 359 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-02/10/2026 | EUR | 368 004 | 0,10 |
| 1 600 000 | AIR FRANCE-KLM 8,125% 23-31/05/2028 | EUR | 1 812 935 | 0,48 | 1 331 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-13/07/2026 | EUR | 1 359 890 | 0,36 |
| 1 700 000 | ALD SA 4,000% 22-05/07/2027 | EUR | 1 733 551 | 0,46 | 1 155 000 | RCI BANQUE 4,750% 22-06/07/2027 | EUR | 1 204 404 | 0,32 |
| 600 000 | ALD SA 4,750% 22-13/10/2025 | EUR | 611 393 | 0,16 | 700 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-14/06/2028 | EUR | 735 745 | 0,20 |
| 600 000 | AREVA SA 4,875% 09-23/09/2024 | EUR | 601 681 | 0,16 | 600 000 | SNCF 4,125% 10-19/02/2025 | EUR | 605 008 | 0,16 |
| 1 000 000 | ATOS SE 1,000% 21-12/11/2029 | EUR | 534 390 | 0,14 | 1 700 000 | SOCIETE GENERALE 3,000% 22-28/10/2025 | EUR | 1 702 856 | 0,46 |
| 2 200 000 | AUCHAN SA 2,375% 19-25/04/2025 | EUR | 2 146 614 | 0,57 | 1 900 000 | SOCIETE GENERALE 4,125% 23-02/06/2027 | EUR | 1 947 882 | 0,52 |
| 100 000 | AUCHAN SA 3,250% 20-23/07/2027 | EUR | 96 927 | 0,03 | 800 000 | SOCIETE GENERALE 4,250% 23-28/09/2026 | EUR | 819 613 | 0,22 |
| 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,010% 21-11/05/2026 | EUR | 92 878 | 0,02 | 1 100 000 | SUEZ 1,875% 22-24/05/2027 | EUR | 1 051 813 | 0,28 |
| 100 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,625% 22-19/11/2027 | EUR | 89 921 | 0,02 | 600 000 | SUEZ ENVIRON 5,500% 09-22/07/2024 | EUR | 604 265 | 0,16 |
| 2 500 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 1,000% 22-23/05/2025 | EUR | 2 415 194 | 0,65 | 300 000 | TELEPERFORMANCE 5,250% 23-22/11/2028 | EUR | 313 524 | 0,08 |
| 1 100 000 | BANQUE STEL FR 4,000% 23-21/01/2027 | EUR | 1 117 761 | 0,30 | 350 000 | TEREOS FIN GROUP 4,750% 22-30/04/2027 | EUR | 351 695 | 0,09 |
| 100 000 | BPCE 0,375% 22-02/02/2026 | EUR | 94 231 | 0,03 | 1 300 000 | URW 0,625% 20-04/05/2027 | EUR | 1 188 675 | 0,32 |
| 200 000 | BPCE 1,750% 22-26/04/2027 | EUR | 191 318 | 0,05 | 400 000 | URW 4,125% 23-11/12/2030 | EUR | 411 651 | 0,11 |
| 800 000 | BPCE 3,625% 23-17/04/2026 | EUR | 806 460 | 0,22 | 1 100 000 | VALEO SE 5,875% 23-12/04/2029 | EUR | 1 179 492 | 0,32 |
| 600 000 | BPCE 4,125% 23-10/07/2028 | EUR | 621 921 | 0,17 | 300 000 | VIVENDI SA 0,625% 19-11/06/2025 | EUR | 288 456 | 0,08 |
| 1 000 000 | CARMILA SA 1,625% 20-30/05/2027 | EUR | 922 151 | 0,25 | 1 645 000 | WPP FINANCE 2,375% 20-19/05/2027 | EUR | 1 611 867 | 0,43 |
| 600 000 | CARMILA SA 5,500% 23-09/10/2028 | EUR | 622 138 | 0,17 | Pays-Bas | | | | |
| 1 000 000 | CARREFOUR BANQUE 0,107% 21-14/06/2025 | EUR | 951 578 | 0,25 | 100 000 | ABN AMRO BANK NV 2,375% 22-01/06/2027 | EUR | 97 289 | 0,03 |
| 1 800 000 | CARREFOUR BANQUE 4,079% 23-05/05/2027 | EUR | 1 826 126 | 0,49 | 900 000 | ABN AMRO BANK NV 3,875% 23-21/12/2026 | EUR | 918 037 | 0,25 |
| 800 000 | CARREFOUR SA 1,875% 22-30/10/2026 | EUR | 772 226 | 0,21 | 2 400 000 | ABN AMRO BANK NV 4,000% 23-16/01/2028 | EUR | 2 459 438 | 0,66 |
| 800 000 | CIE DE ST GOBAIN 2,375% 20-04/10/2027 | EUR | 784 145 | 0,21 | 443 000 | ACHMEA BV 3,625% 22-29/11/2025 | EUR | 444 531 | 0,12 |
| 1 300 000 | CIE DE ST GOBAIN 3,750% 23-29/11/2026 | EUR | 1 321 213 | 0,35 | 138 000 | ASR NEDERLAND NV 3,625% 23-12/12/2028 | EUR | 139 808 | 0,04 |
| 400 000 | COVIVIO 4,625% 23-05/06/2032 | EUR | 414 693 | 0,11 | 1 000 000 | COOPERATIEVE RAB 3,913% 23-03/11/2026 | EUR | 1 022 014 | 0,27 |
| 1 600 000 | CREDIT AGRICOLE SA 3,375% 22-28/07/2027 | EUR | 1 610 204 | 0,43 | 584 000 | DEUTSCHE TEL FIN 4,875% 10-22/04/2025 | EUR | 600 868 | 0,16 |
| 600 000 | DANONE 3,706% 23-13/11/2029 | EUR | 625 101 | 0,17 | 472 000 | ENBW 4,300% 23-23/05/2034 | EUR | 498 435 | 0,13 |
| 1 700 000 | EDENRED 3,625% 23-13/12/2026 | EUR | 1 722 182 | 0,46 | 584 000 | ENBW INTERNATIONAL FIN 4,875% 04-16/01/2025 | EUR | 591 302 | 0,16 |
| 700 000 | ELEC DE FRANCE 3,750% 23-05/06/2027 | EUR | 713 485 | 0,19 | 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0,000% 19-17/06/2024 | EUR | 98 175 | 0,03 |
| 600 000 | ELEC DE FRANCE 4,000% 10-12/11/2025 | EUR | 609 665 | 0,16 | 2 275 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0,250% 22-17/11/2025 | EUR | 2 151 324 | 0,58 |
| 600 000 | ELEC DE FRANCE 4,625% 09-11/09/2024 | EUR | 602 768 | 0,16 | 1 079 000 | HEIMSTADEN BOST 0,250% 21-13/10/2024 | EUR | 1 014 903 | 0,27 |
| 1 900 000 | ELO SACA 6,000% 23-22/03/2029 | EUR | 1 926 069 | 0,52 | 100 000 | HEIMSTADEN BOST 0,625% 22-24/07/2025 | EUR | 88 479 | 0,02 |
| 1 800 000 | ENGIE 0,375% 19-21/06/2027 | EUR | 1 642 435 | 0,44 | 751 000 | HEINEKEN NV 3,625% 23-15/11/2026 | EUR | 762 629 | 0,20 |
| 700 000 | ENGIE 3,625% 23-06/12/2026 | EUR | 709 687 | 0,19 | 1 000 000 | ING BANK NV 4,125% 23-02/10/2026 | EUR | 1 023 995 | 0,27 |
| 1 300 000 | ENGIE 3,750% 23-06/09/2027 | EUR | 1 326 144 | 0,35 | 200 000 | JDE PEETS NV 0,000% 21-16/01/2026 | EUR | 186 864 | 0,05 |
| 350 000 | FAURECIA 2,750% 21-15/02/2027 | EUR | 334 042 | 0,09 | 600 000 | KPN NV 5,625% 09-30/09/2024 | EUR | 606 877 | 0,16 |
| 1 900 000 | HOLDING DINFRA 2,500% 20-04/05/2027 | EUR | 1 841 907 | 0,49 | 302 000 | LEASEPLAN CORP 0,250% 21-07/09/2026 | EUR | 277 153 | 0,07 |
| 1 000 000 | ICADE 1,500% 17-13/09/2027 | EUR | 929 810 | 0,25 | 1 460 000 | MERCEDES-BENZ IN 3,500% 23-30/05/2026 | EUR | 1 474 980 | 0,39 |
| 2 100 000 | ICADE 1,750% 16-10/06/2026 | EUR | 2 002 952 | 0,54 | 300 000 | NIBC BANK NV 0,250% 21-09/09/2026 | EUR | 273 720 | 0,07 |
| 1 100 000 | JCDECAUX SA 2,000% 20-24/10/2024 | EUR | 1 081 734 | 0,29 | 100 000 | NIBC BANK NV 0,875% 22-24/06/2027 | EUR | 91 002 | 0,02 |
| 900 000 | JCDECAUX SE 5,000% 23-11/01/2029 | EUR | 945 238 | 0,25 | 900 000 | NN BANK NV 0,500% 21-21/09/2028 | EUR | 793 143 | 0,21 |
| 1 600 000 | KERING 1,500% 17-05/04/2027 | EUR | 1 530 140 | 0,41 | 974 000 | ROCHE FINANCE EU 3,312% 23-04/12/2027 | EUR | 996 358 | 0,27 |
| 1 500 000 | LOREAL SA 3,375% 23-23/01/2027 | EUR | 1 524 225 | 0,41 | 997 000 | SANDOZ FINANCE 3,970% 23-17/04/2027 | EUR | 1 016 562 | 0,27 |
| 900 000 | LOREAL SA 3,375% 23-23/11/2029 | EUR | 927 320 | 0,25 | 841 000 | SANDOZ FINANCE 4,220% 23-17/04/2030 | EUR | 871 232 | 0,23 |
| 100 000 | MERCIALYS 1,800% 18-27/02/2026 | EUR | 95 428 | 0,03 | 900 000 | SIEMENS FINAN 2,500% 22-08/09/2027 | EUR | 894 038 | 0,24 |
| 2 200 000 | ORANO SA 5,375% 22-15/05/2027 | EUR | 2 299 386 | 0,61 | 1 416 000 | SIKA CAPITAL BV 3,750% 23-03/11/2026 | EUR | 1 439 237 | 0,38 |
| 1 600 000 | PSA BANQUE FRANC 0,000% 21-22/01/2025 | EUR | 1 537 870 | 0,41 | 1 450 000 | TOYOTA MOTOR FIN 3,375% 23-13/01/2026 | EUR | 1 454 841 | 0,39 |
| 700 000 | PSA BANQUE FRANC 3,875% 23-19/01/2026 | EUR | 704 654 | 0,19 | 100 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,125% 22-28/03/2025 | EUR | 99 308 | 0,03 |
| 822 000 | RCI BANQUE 1,625% 18-26/05/2026 | EUR | 785 246 | 0,21 | 600 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,750% 22-28/09/2027 | EUR | 608 089 | 0,16 |
| 1 572 000 | RCI BANQUE 4,125% 22-01/12/2025 | EUR | 1 582 264 | 0,42 | 900 000 | VOLKSWAGEN INTFN 3,875% 23-29/03/2026 | EUR | 905 797 | 0,24 |
| | | | | | 2 700 000 | VOLKSWAGEN INTFN 4,125% 22-15/11/2025 | EUR | 2 732 263 | 0,73 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Short Term Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 1 000 000 | VONOVIA BV 0,625% 19-07/10/2027 | EUR | 893 343 | 0,24 | | | | | |
| 2 900 000 | VONOVIA BV 1,125% 17-08/09/2025 | EUR | 2 773 749 | 0,74 | | | | | |
| 2 900 000 | VONOVIA BV 1,800% 19-29/06/2025 | EUR | 2 803 646 | 0,75 | | | | | |
| 800 000 | ZF EUROPE FIN BV 6,125% 23-13/03/2029 | EUR | 848 649 | 0,23 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>24 218 346</i> | <i>6,47</i> | | | | | |
| 1 808 000 | A2A SPA 2,500% 22-15/06/2026 | EUR | 1 774 396 | 0,47 | | | | | |
| 3 900 000 | ACEA SPA 1,500% 18-08/06/2027 | EUR | 3 683 968 | 0,99 | | | | | |
| 600 000 | ASSICURAZIONI GENERALI 5,125% 09-16/09/2024 | EUR | 603 603 | 0,16 | | | | | |
| 600 000 | ATLANTIA 4,375% 10-16/09/2025 | EUR | 606 254 | 0,16 | | | | | |
| 600 000 | ATLANTIA 5,875% 04-09/06/2024 | EUR | 603 902 | 0,16 | | | | | |
| 1 411 000 | AUTOSTRADA TORIN 1,000% 21-25/11/2026 | EUR | 1 313 390 | 0,35 | | | | | |
| 2 200 000 | AUTOSTRAD PER L 1,750% 16-01/02/2027 | EUR | 2 080 291 | 0,56 | | | | | |
| 811 000 | BANCO BPM SPA 4,625% 23-29/11/2027 | EUR | 835 073 | 0,22 | | | | | |
| 600 000 | ENEL SOC AZIONI 5,250% 04-20/05/2024 | EUR | 602 474 | 0,16 | | | | | |
| 1 795 000 | ENI SPA 1,250% 20-18/05/2026 | EUR | 1 719 026 | 0,46 | | | | | |
| 1 302 000 | ENI SPA 3,625% 23-19/05/2027 | EUR | 1 320 981 | 0,35 | | | | | |
| 500 000 | INTESA SANPAOLO 0,625% 21-24/02/2026 | EUR | 469 789 | 0,13 | | | | | |
| 2 510 000 | INTESA SANPAOLO 1,000% 19-19/11/2026 | EUR | 2 349 775 | 0,63 | | | | | |
| 100 000 | INTESA SANPAOLO 2,125% 20-26/05/2025 | EUR | 97 960 | 0,03 | | | | | |
| 700 000 | INTESA SANPAOLO 4,000% 23-19/05/2026 | EUR | 709 752 | 0,19 | | | | | |
| 1 000 000 | INTESA SANPAOLO 4,500% 23-02/10/2025 | EUR | 1 017 088 | 0,27 | | | | | |
| 600 000 | INTESA SANPAOLO 4,750% 22-06/09/2027 | EUR | 621 629 | 0,17 | | | | | |
| 1 126 000 | SNAM 3,375% 22-05/12/2026 | EUR | 1 134 192 | 0,30 | | | | | |
| 600 000 | TERNA SPA 4,900% 04-28/10/2024 | EUR | 604 992 | 0,16 | | | | | |
| 2 200 000 | UNICREDIT SPA 0,325% 21-19/01/2026 | EUR | 2 069 811 | 0,55 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>20 514 831</i> | <i>5,49</i> | | | | | |
| 1 800 000 | BASF SE 0,750% 22-17/03/2026 | EUR | 1 708 647 | 0,46 | | | | | |
| 500 000 | BERTELSMANN SE 1,125% 16-27/04/2026 | EUR | 479 294 | 0,13 | | | | | |
| 2 400 000 | DEUTSCHE BANK AG 1,625% 20-20/01/2027 | EUR | 2 252 523 | 0,60 | | | | | |
| 500 000 | DEUTSCHE BANK AG 4,000% 22-29/11/2027 | EUR | 513 696 | 0,14 | | | | | |
| 100 000 | DEUTSCHE WOHNEN 1,000% 20-30/04/2025 | EUR | 95 750 | 0,03 | | | | | |
| 2 400 000 | DT LUFTHANSA AG 3,750% 21-11/02/2028 | EUR | 2 358 862 | 0,63 | | | | | |
| 350 000 | GRUENENTHAL GMBH 6,750% 23-15/05/2030 | EUR | 370 394 | 0,10 | | | | | |
| 1 100 000 | LEG IMMOBILIEN SE 0,375% 22-17/01/2026 | EUR | 1 028 830 | 0,28 | | | | | |
| 1 100 000 | ROBERT BOSCH 3,625% 23-02/06/2027 | EUR | 1 122 779 | 0,30 | | | | | |
| 600 000 | VIER GAS TRANSPO 4,000% 22-26/09/2027 | EUR | 616 424 | 0,16 | | | | | |
| 1 400 000 | VOLKSWAGEN BANK 4,250% 23-07/01/2026 | EUR | 1 416 273 | 0,38 | | | | | |
| 700 000 | VOLKSWAGEN BANK 4,375% 23-03/05/2028 | EUR | 720 994 | 0,19 | | | | | |
| 975 000 | VOLKSWAGEN FIN 0,125% 21-12/02/2027 | EUR | 884 569 | 0,24 | | | | | |
| 2 238 000 | VOLKSWAGEN FIN 2,250% 19-01/10/2027 | EUR | 2 173 891 | 0,58 | | | | | |
| 2 053 000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL 0,250% 22-31/01/2025 | EUR | 1 978 733 | 0,53 | | | | | |
| 19 000 | VOLKSWAGEN LEAS 0,375% 21-20/07/2026 | EUR | 17 606 | 0,00 | | | | | |
| 782 000 | VOLKSWAGEN LEAS 4,500% 23-25/03/2026 | EUR | 798 338 | 0,21 | | | | | |
| 494 000 | VOLKSWAGEN LEAS 4,625% 23-25/03/2029 | EUR | 520 362 | 0,14 | | | | | |
| 200 000 | VONOVIA SE 0,000% 21-01/12/2025 | EUR | 186 423 | 0,05 | | | | | |
| 300 000 | VONOVIA SE 0,000% 21-16/09/2024 | EUR | 291 193 | 0,08 | | | | | |
| 700 000 | VONOVIA SE 1,375% 22-28/01/2026 | EUR | 668 520 | 0,18 | | | | | |
| 300 000 | VONOVIA SE 4,750% 22-23/05/2027 | EUR | 310 730 | 0,08 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>17 886 467</i> | <i>4,79</i> | | | | | |
| 850 000 | BRITISH TELECOMM 1,500% 17-23/06/2027 | EUR | 803 375 | 0,21 | | | | | |
| 878 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 903 118 | 0,24 | | | | | |
| 584 000 | GLAXOSMITHKLINE 4,000% 05-16/06/2025 | EUR | 588 912 | 0,16 | | | | | |
| 2 300 000 | INTERNATIONAL CONSOLIDAT 3,750% 21-25/03/2029 | EUR | 2 225 273 | 0,60 | | | | | |
| 2 310 000 | ITV PLC 1,375% 19-26/09/2026 | EUR | 2 171 515 | 0,58 | | | | | |
| 1 200 000 | LINDE PLC 3,625% 23-12/06/2025 | EUR | 1 207 043 | 0,32 | | | | | |
| 798 000 | LLOYDS BANK 4,125% 23-30/05/2027 | EUR | 816 563 | 0,22 | | | | | |
| 1 500 000 | MONDI FINANCE PL 1,625% 18-27/04/2026 | EUR | 1 447 278 | 0,39 | | | | | |
| 800 000 | NATIONAL GRID PLC 2,179% 22-30/06/2026 | EUR | 777 378 | 0,21 | | | | | |
| 100 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 2,000% 22-28/04/2027 | EUR | 96 069 | 0,03 | | | | | |
| 2 450 000 | NATWEST MARKETS 0,125% 21-12/11/2025 | EUR | 2 307 230 | 0,62 | | | | | |
| 100 000 | NATWEST MARKETS 0,125% 21-18/06/2026 | EUR | 92 615 | 0,02 | | | | | |
| 200 000 | NATWEST MARKETS 2,000% 22-27/08/2025 | EUR | 194 953 | 0,05 | | | | | |
| 2 200 000 | RENTOKIL FINANC 3,875% 22-27/06/2027 | EUR | 2 239 549 | 0,60 | | | | | |
| 903 000 | SAGE GROUP 3,820% 23-15/02/2028 | EUR | 927 918 | 0,25 | | | | | |
| 1 150 000 | TESCO CORP TREAS 0,875% 19-29/05/2026 | EUR | 1 087 678 | 0,29 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>15 010 810</i> | <i>4,01</i> | | | | | |
| 700 000 | ABERTIS INFRAEST 4,125% 23-31/01/2028 | EUR | 719 430 | 0,19 | | | | | |
| 2 400 000 | ARVAL SERVICE 4,000% 22-22/09/2026 | EUR | 2 427 397 | 0,65 | | | | | |
| 1 700 000 | ARVAL SERVICE 4,125% 23-13/04/2026 | EUR | 1 719 421 | 0,46 | | | | | |
| 600 000 | ARVAL SERVICE 4,250% 23-11/11/2025 | EUR | 606 494 | 0,16 | | | | | |
| 1 100 000 | ARVAL SERVICE 4,750% 22-22/05/2027 | EUR | 1 140 545 | 0,30 | | | | | |
| 100 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1,750% 22-26/11/2025 | EUR | 97 245 | 0,03 | | | | | |
| 1 100 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 3,375% 22-20/09/2027 | EUR | 1 109 536 | 0,30 | | | | | |
| 200 000 | BANCO SANTANDER 0,300% 19-04/10/2026 | EUR | 185 739 | 0,05 | | | | | |
| 2 100 000 | BANCO SANTANDER 1,125% 20-23/06/2027 | EUR | 1 958 100 | 0,52 | | | | | |
| 100 000 | CAIXABANK 0,375% 20-03/02/2025 | EUR | 96 488 | 0,03 | | | | | |
| 400 000 | CAIXABANK 4,375% 23-29/11/2033 | EUR | 419 911 | 0,11 | | | | | |
| 687 000 | EDP SERVICIOS 4,125% 23-04/04/2029 | EUR | 714 694 | 0,19 | | | | | |
| 1 100 000 | INMOBILIARIA COL 1,350% 20-14/10/2028 | EUR | 1 013 126 | 0,27 | | | | | |
| 2 900 000 | INMOBILIARIA COL 2,000% 18-17/04/2026 | EUR | 2 802 684 | 0,75 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>13 830 370</i> | <i>3,71</i> | | | | | |
| 500 000 | AT&T INC 0,250% 19-04/03/2026 | EUR | 469 107 | 0,13 | | | | | |
| 527 000 | BANK OF AMERICA CORP 4,134% 23-12/06/2028 | EUR | 543 124 | 0,15 | | | | | |
| 768 000 | BOOKING HLDS INC 3,625% 23-12/11/2028 | EUR | 788 935 | 0,21 | | | | | |
| 273 000 | CARRIER GLOBAL 4,125% 23-29/05/2028 | EUR | 280 775 | 0,08 | | | | | |
| 1 500 000 | CATERPILLAR FINL 3,742% 23-04/09/2026 | EUR | 1 529 324 | 0,41 | | | | | |
| 1 100 000 | DIGITAL EURO FIN 2,500% 19-16/01/2026 | EUR | 1 070 377 | 0,29 | | | | | |
| 1 002 000 | FORD MOTOR CREDIT 5,125% 23-20/02/2029 | EUR | 1 047 514 | 0,28 | | | | | |
| 1 343 000 | IBM CORP 3,375% 23-06/02/2027 | EUR | 1 358 667 | 0,36 | | | | | |
| 248 000 | IHG FINANCE LLC 4,375% 23-28/11/2029 | EUR | 256 867 | 0,07 | | | | | |
| 1 900 000 | NETFLIX INC 3,000% 20-15/06/2025 | EUR | 1 883 990 | 0,50 | | | | | |
| 1 900 000 | NETFLIX INC 3,625% 17-15/05/2027 | EUR | 1 922 060 | 0,51 | | | | | |
| 2 300 000 | PRICELINE GROUP 1,800% 15-03/03/2027 | EUR | 2 211 417 | 0,59 | | | | | |
| 462 000 | STRYKER CORP 3,375% 23-11/12/2028 | EUR | 468 213 | 0,13 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Short Term Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Luxembourg | | 7 673 745 | 2,04 | | Autriche | | 96 161 | 0,03 |
| 1 900 000 | BECTON DICKINSON 1,208% 19-04/06/2026 | EUR | 1 812 479 | 0,48 | 100 000 | ERSTE GROUP 1,500% 22-07/04/2026 | EUR | 96 161 | 0,03 |
| 100 000 | EUROFINS SCIENTIFIC 2,125% 17-25/07/2024 | EUR | 98 695 | 0,03 | | Obligations à taux flottant | | 108 334 266 | 29,00 |
| 500 000 | GRAND CITY PROPERTIES 0,125% 21-11/01/2028 | EUR | 419 090 | 0,11 | | France | | 28 917 026 | 7,73 |
| 100 000 | LOGICOR FIN 0,625% 22-17/11/2025 | EUR | 93 118 | 0,02 | 1 500 000 | AXA SA 14-20/05/2049 FRN | EUR | 1 476 143 | 0,39 |
| 550 000 | LOGICOR FIN 1,625% 19-15/07/2027 | EUR | 504 210 | 0,13 | 900 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 22-16/06/2032 FRN | EUR | 888 350 | 0,24 |
| 2 073 000 | NESTLE FINANCE INTERNATIONAL 3,500% 23-13/12/2027 | EUR | 2 139 240 | 0,57 | 600 000 | BNP PARIBAS 14-31/12/2049 FRN | EUR | 590 169 | 0,16 |
| 100 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 0,125% 21-24/03/2025 | EUR | 95 563 | 0,03 | 1 900 000 | BNP PARIBAS 20-15/01/2032 FRN | EUR | 1 731 238 | 0,46 |
| 1 300 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 4,000% 23-16/09/2025 | EUR | 1 305 759 | 0,35 | 100 000 | BNP PARIBAS 21-13/04/2027 FRN | EUR | 92 649 | 0,02 |
| 600 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 4,125% 22-22/11/2025 | EUR | 604 411 | 0,16 | 1 600 000 | BNP PARIBAS 22-25/07/2028 FRN | EUR | 1 557 166 | 0,42 |
| 600 000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 4,125% 23-18/01/2025 | EUR | 601 180 | 0,16 | 500 000 | BNP PARIBAS 22-31/03/2032 FRN | EUR | 473 011 | 0,13 |
| | Suède | | 5 039 576 | 1,34 | 1 000 000 | BPCE 21-13/01/2042 FRN | EUR | 906 037 | 0,24 |
| 320 000 | MOLNLYCKE HLD 4,250% 23-08/09/2028 | EUR | 328 062 | 0,09 | 1 200 000 | CNP ASSURANCES 14-05/06/2045 FRN | EUR | 1 192 809 | 0,32 |
| 200 000 | SBAB BANK AB 1,875% 22-10/12/2025 | EUR | 194 193 | 0,05 | 600 000 | CNP ASSURANCES 14-29/11/2049 FRN | EUR | 594 318 | 0,16 |
| 500 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 3,875% 23-09/05/2028 | EUR | 511 638 | 0,14 | 800 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 14-31/10/2049 FRN | EUR | 794 902 | 0,21 |
| 1 365 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK 4,125% 23-29/06/2027 | EUR | 1 404 984 | 0,38 | 200 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 15-29/01/2049 FRN | EUR | 198 468 | 0,05 |
| 100 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 0,125% 21-03/11/2026 | EUR | 91 875 | 0,02 | 1 000 000 | CREDIT AGRICOLE SA 20-22/04/2026 FRN | EUR | 964 369 | 0,26 |
| 745 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 3,875% 23-10/05/2027 | EUR | 759 997 | 0,20 | 600 000 | CREDIT AGRICOLE SA 22-12/10/2026 FRN | EUR | 604 637 | 0,16 |
| 1 533 000 | SWEDBANK AB 4,625% 23-30/05/2026 | EUR | 1 548 178 | 0,41 | 1 700 000 | CREDIT AGRICOLE SA 22-22/04/2027 FRN | EUR | 1 638 490 | 0,44 |
| 216 000 | VOLVO TREAS AB 0,000% 21-18/05/2026 | EUR | 200 649 | 0,05 | 1 100 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 20-11/06/2029 FRN | EUR | 996 854 | 0,27 |
| | Irlande | | 4 798 965 | 1,29 | 400 000 | ENGIE 19-31/12/2059 FRN | EUR | 384 143 | 0,10 |
| 1 250 000 | CA AUTO BANK 4,375% 23-08/06/2026 | EUR | 1 269 039 | 0,34 | 600 000 | GROUPAMA SA 14-28/05/2049 FRN | EUR | 599 990 | 0,16 |
| 2 100 000 | DELL BANK INTERN 0,500% 21-27/10/2026 | EUR | 1 942 540 | 0,52 | 600 000 | LA MONDIALE 14-29/12/2049 FRN | EUR | 598 977 | 0,16 |
| 100 000 | FCA BANK IE 0,000% 21-16/04/2024 | EUR | 98 889 | 0,03 | 1 800 000 | SOCIETE GENERALE 20-24/11/2030 FRN | EUR | 1 687 633 | 0,45 |
| 1 513 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,875% 18-15/01/2026 | EUR | 1 488 497 | 0,40 | 1 500 000 | SOCIETE GENERALE 21-02/12/2027 FRN | EUR | 1 374 537 | 0,37 |
| | Finlande | | 2 978 129 | 0,81 | 4 000 000 | SOCIETE GENERALE 21-17/11/2026 FRN | EUR | 3 766 061 | 1,01 |
| 2 043 000 | NOKIA OYJ 2,000% 19-11/03/2026 | EUR | 1 965 559 | 0,53 | 1 400 000 | SOCIETE GENERALE 21-30/06/2031 FRN | EUR | 1 286 198 | 0,34 |
| 100 000 | NORDEA BANK ABP 1,125% 22-16/02/2027 | EUR | 93 898 | 0,03 | 1 900 000 | SOGECAP SA 14-29/12/2049 FRN | EUR | 1 869 090 | 0,50 |
| 909 000 | STORA ENSO OYJ 4,000% 23-01/06/2026 | EUR | 918 672 | 0,25 | 1 300 000 | TOTAL SA 15-29/12/2049 FRN | EUR | 1 269 256 | 0,34 |
| | Danemark | | 2 477 095 | 0,66 | 1 500 000 | TOTALENERGIES SE 22-31/12/2062 FRN | EUR | 1 381 531 | 0,37 |
| 1 575 000 | CARLSBERG BREW 0,375% 20-30/06/2027 | EUR | 1 435 496 | 0,38 | | Espagne | | 21 096 882 | 5,63 |
| 101 000 | COLOPLAST FINANC 2,250% 22-19/05/2027 | EUR | 97 941 | 0,03 | 2 700 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 20-16/01/2030 FRN | EUR | 2 595 210 | 0,69 |
| 100 000 | NYKREDIT 1,375% 22-12/07/2027 | EUR | 93 484 | 0,02 | 500 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 23-10/05/2026 FRN | EUR | 503 012 | 0,13 |
| 847 000 | ORSTED A/S 3,625% 23-01/03/2026 | EUR | 850 174 | 0,23 | 1 900 000 | BANCO SABADELL 22-08/09/2026 FRN | EUR | 1 936 191 | 0,52 |
| | Norvège | | 1 616 081 | 0,44 | 1 000 000 | BANCO SABADELL 23-07/02/2029 FRN | EUR | 1 032 137 | 0,28 |
| 100 000 | SANTANDER CONSUM 0,500% 22-11/08/2025 | EUR | 95 028 | 0,03 | 1 500 000 | BANCO SABADELL 23-07/06/2029 FRN | EUR | 1 575 209 | 0,42 |
| 100 000 | SPAREBANK 1 OEST 1,750% 22-27/04/2027 | EUR | 95 025 | 0,03 | 900 000 | BANCO SABADELL 23-08/09/2029 FRN | EUR | 935 358 | 0,25 |
| 1 343 000 | SPAREBANK 1 SMN 3,125% 22-22/12/2025 | EUR | 1 334 196 | 0,36 | 300 000 | BANCO SABADELL 23-16/08/2033 FRN | EUR | 303 328 | 0,08 |
| 100 000 | SPAREBANK 1 SR 0,250% 21-09/11/2026 | EUR | 91 832 | 0,02 | 100 000 | BANCO SANTANDER 22-26/01/2025 FRN | EUR | 99 704 | 0,03 |
| | Suisse | | 1 141 552 | 0,31 | 1 400 000 | BANCO SANTANDER 22-27/09/2026 FRN | EUR | 1 401 563 | 0,37 |
| 1 300 000 | UBS GROUP 0,250% 21-24/02/2028 | EUR | 1 141 552 | 0,31 | 800 000 | BANCO SANTANDER 23-18/10/2027 FRN | EUR | 819 406 | 0,22 |
| | Islande | | 998 526 | 0,27 | 500 000 | BANCO SANTANDER 23-23/08/2033 FRN | EUR | 523 726 | 0,14 |
| 1 050 000 | ISLANDSBANKI 0,750% 22-25/03/2025 | EUR | 998 526 | 0,27 | 2 200 000 | CAIXABANK 20-10/07/2026 FRN | EUR | 2 112 806 | 0,56 |
| | Belgique | | 780 470 | 0,21 | 200 000 | CAIXABANK 20-18/11/2026 FRN | EUR | 188 206 | 0,05 |
| 800 000 | PROXIMUS SA 1,875% 15-01/10/2025 | EUR | 780 470 | 0,21 | 1 100 000 | CAIXABANK 21-18/06/2031 FRN | EUR | 1 023 733 | 0,27 |
| | Japon | | 97 059 | 0,03 | 1 800 000 | CAIXABANK 22-13/04/2026 FRN | EUR | 1 751 159 | 0,47 |
| 100 000 | ASAHI GROUP 0,155% 20-23/10/2024 | EUR | 97 059 | 0,03 | 2 300 000 | CAIXABANK 23-16/05/2027 FRN | EUR | 2 346 562 | 0,63 |
| | | | | | 1 100 000 | CAIXABANK 23-19/07/2029 FRN | EUR | 1 149 695 | 0,31 |
| | | | | | 900 000 | IBERDROLA FIN SA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 799 877 | 0,21 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Short Term Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Pays-Bas | | | | | Portugal | | | | |
| 600 000 | ACHMEA BV 15-29/12/2049 FRN | EUR | 12 703 951 | 3,39 | 900 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 21-07/04/2028 FRN | EUR | 5 100 622 | 1,36 |
| 600 000 | ASR NEDERLAND NV 14-30/09/2049 FRN | EUR | 593 307 | 0,16 | 2 500 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 21-12/02/2027 FRN | EUR | 839 836 | 0,22 |
| 1 050 000 | ASR NEDERLAND NV 15-29/09/2045 FRN | EUR | 598 390 | 0,16 | 400 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 23-02/10/2026 FRN | EUR | 2 361 016 | 0,63 |
| 1 600 000 | COOPERATIEVE RAB 20-05/05/2028 FRN | EUR | 1 060 237 | 0,28 | 1 400 000 | CAIXA GERAL DEPO 21-21/09/2027 FRN | EUR | 410 770 | 0,11 |
| 600 000 | GENERALI FINANCE 14-30/11/2049 FRN | EUR | 1 474 101 | 0,39 | 200 000 | CAIXA GERAL DEPO 22-15/06/2026 FRN | EUR | 1 291 829 | 0,35 |
| 1 700 000 | ING GROEP NV 22-23/05/2026 FRN | EUR | 596 278 | 0,16 | Irlande | | | | |
| 600 000 | NN GROUP NV 14-15/07/2049 FRN | EUR | 1 662 338 | 0,44 | 100 000 | AIB GROUP PLC 22-04/04/2028 FRN | EUR | 4 523 877 | 1,22 |
| 600 000 | NN GROUP NV 14-29/06/2049 FRN | EUR | 596 010 | 0,16 | 100 000 | AIB GROUP PLC 22-04/07/2026 FRN | EUR | 95 786 | 0,03 |
| 600 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 15-25/03/2075 FRN | EUR | 594 230 | 0,16 | 1 426 000 | BANK OF IRELAND 21-10/05/2027 FRN | EUR | 99 978 | 0,03 |
| 900 000 | SWISS LIFE 16-29/12/2049 FRN | EUR | 596 903 | 0,16 | 2 066 000 | BANK OF IRELAND 22-05/06/2026 FRN | EUR | 1 325 383 | 0,35 |
| 1 300 000 | SWISS RE 15-29/12/2049 FRN | EUR | 889 321 | 0,24 | 463 000 | BANK OF IRELAND 23-13/11/2029 FRN | EUR | 2 008 690 | 0,54 |
| 1 459 000 | VOLKSWAGEN INTFN 14-29/03/2049 FRN | EUR | 1 252 560 | 0,33 | 491 000 | BANK OF IRELAND 23-16/07/2028 FRN | EUR | 480 880 | 0,13 |
| 600 000 | VOLKSWAGEN INTFN 17-31/12/2049 FRN | EUR | 1 442 384 | 0,39 | Norvège | | | | |
| 800 000 | VOLKSWAGEN INTFN 20-31/12/2060 FRN | EUR | 570 895 | 0,15 | 1 100 000 | DNB BANK ASA 21-23/02/2029 FRN | EUR | 3 135 642 | 0,83 |
| Italie | | | | | 100 000 | DNB BANK ASA 22-18/01/2028 FRN | EUR | 964 638 | 0,26 |
| 800 000 | ENEL SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 887 481 | 0,24 | 200 000 | DNB BANK ASA 22-31/05/2026 FRN | EUR | 91 621 | 0,02 |
| 1 000 000 | INTESA SANPAOLO 23-08/03/2028 FRN | EUR | 887 481 | 0,24 | 433 000 | DNB BANK ASA 23-01/11/2029 FRN | EUR | 194 680 | 0,05 |
| 602 000 | MEDIOBANCA SPA 23-01/02/2030 FRN | EUR | 697 380 | 0,19 | 1 335 000 | DNB BANK ASA 23-16/02/2027 FRN | EUR | 454 889 | 0,12 |
| 1 548 000 | MEDIOBANCA SPA 23-14/03/2028 FRN | EUR | 1 034 158 | 0,28 | 100 000 | SPAREBANK 1 SR 21-15/07/2027 FRN | EUR | 1 338 195 | 0,36 |
| 2 300 000 | UNICREDIT SPA 20-16/06/2026 FRN | EUR | 619 462 | 0,17 | Autriche | | | | |
| 250 000 | UNICREDIT SPA 20-20/01/2026 FRN | EUR | 1 598 784 | 0,43 | 2 100 000 | RAIFFEISEN BK IN 23-26/01/2027 FRN | EUR | 2 118 741 | 0,57 |
| 966 000 | UNICREDIT SPA 21-05/07/2029 FRN | EUR | 2 218 691 | 0,59 | Danemark | | | | |
| 851 000 | UNICREDIT SPA 23-14/02/2030 FRN | EUR | 242 502 | 0,06 | 100 000 | DANSKE BANK A/S 22-17/02/2027 FRN | EUR | 2 020 092 | 0,55 |
| Allemagne | | | | | 600 000 | DANSKE BANK A/S 23-12/01/2027 FRN | EUR | 95 073 | 0,03 |
| 1 000 000 | ALLIANZ SE 15-07/07/2045 FRN | EUR | 7 974 212 | 2,15 | 264 000 | JYSKE BANK A/S 21-02/09/2026 FRN | EUR | 604 459 | 0,16 |
| 400 000 | BAYER AG 22-25/03/2082 FRN | EUR | 970 192 | 0,26 | 1 100 000 | ORSTED A/S 17-24/11/3017 FRN | EUR | 247 826 | 0,07 |
| 300 000 | BAYER AG 23-25/09/2083 FRN | EUR | 379 900 | 0,10 | Suisse | | | | |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 20-24/03/2026 FRN | EUR | 304 980 | 0,08 | 1 407 000 | UBS GROUP 20-29/01/2026 FRN | EUR | 1 543 387 | 0,41 |
| 100 000 | COMMERZBANK AG 22-14/09/2027 FRN | EUR | 95 969 | 0,03 | 200 000 | UBS GROUP 22-15/06/2027 FRN | EUR | 1 347 660 | 0,36 |
| 200 000 | COMMERZBANK AG 23-25/03/2029 FRN | EUR | 97 860 | 0,03 | Etats-Unis d'Amérique | | | | |
| 97 000 | DEUTSCHE BANK AG 20-10/06/2026 FRN | EUR | 209 939 | 0,06 | 584 000 | CITIGROUP INC 05-25/02/2030 SR FRN | EUR | 1 172 763 | 0,32 |
| 1 000 000 | DEUTSCHE BANK AG 20-19/05/2031 FRN | EUR | 93 952 | 0,03 | 570 000 | MORGAN STANLEY 23-02/03/2029 FRN | EUR | 581 103 | 0,16 |
| 1 600 000 | DEUTSCHE BANK AG 20-19/11/2025 FRN | EUR | 1 012 640 | 0,27 | Grèce | | | | |
| 1 500 000 | DEUTSCHE BANK AG 21-17/02/2027 FRN | EUR | 1 555 279 | 0,42 | 953 000 | PIRAEUS BANK 23-05/12/2029 FRN | EUR | 999 055 | 0,27 |
| 2 000 000 | MERCK 20-09/09/2080 FRN | EUR | 1 399 761 | 0,37 | Finlande | | | | |
| Royaume-Uni | | | | | 687 000 | NORDEA BANK ABP 23-06/09/2026 FRN | EUR | 981 255 | 0,27 |
| 600 000 | AVIVA PLC 14-03/07/2044 FRN | EUR | 5 515 124 | 1,48 | 275 000 | NORDEA BANK ABP 23-23/02/2034 FRN | EUR | 695 641 | 0,19 |
| 1 048 000 | BARCLAYS BANK PLC 21-22/03/2031 FRN | EUR | 594 608 | 0,16 | Suède | | | | |
| 1 405 000 | BARCLAYS BANK PLC 22-28/01/2028 FRN | EUR | 965 326 | 0,26 | 964 000 | NORDEA BANK AB 23-10/02/2026 FRN | EUR | 961 028 | 0,26 |
| 100 000 | BARCLAYS BANK PLC 22-31/01/2027 FRN | EUR | 1 289 085 | 0,34 | Belgique | | | | |
| 584 000 | HBOS PLC 05-18/03/2030 SR FRN | EUR | 98 283 | 0,03 | 100 000 | KBC GROUP NV 22-21/01/2028 FRN | EUR | 810 718 | 0,21 |
| 600 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 20-18/03/2030 FRN | EUR | 581 681 | 0,16 | 700 000 | KBC GROUP NV 23-28/11/2029 FRN | EUR | 91 963 | 0,02 |
| 500 000 | NATWEST GROUP 21-14/09/2032 FRN | EUR | 598 604 | 0,16 | Australie | | | | |
| 1 000 000 | SSE PLC 20-31/12/2060 FRN | EUR | 441 668 | 0,12 | 600 000 | BHP BILLITON FIN 15-22/10/2079 FRN | EUR | 718 755 | 0,19 |
| | | | | | Obligations à taux flottants | | | | |
| | | | | | France | | | | |
| | | | | | 800 000 | COMP 2023-FRI A 23-28/10/2035 FRN | EUR | 603 402 | 0,16 |
| | | | | | 600 000 | HLFCT 2023-1 A 23-31/10/2057 FRN | EUR | 603 007 | 0,16 |
| | | | | | Irlande | | | | |
| | | | | | 880 000 | FIAR 1 A 23-12/09/2033 FRN | EUR | 881 873 | 0,24 |

BNP PARIBAS FUNDS Euro Short Term Corporate Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Autres valeurs mobilières | | 0 | 0,00 |
| | Obligations | | 0 | 0,00 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>0</i> | <i>0,00</i> |
| 8 000 000 | LEHMAN BROS HLDG 0,000% 07-31/12/2049 SR DFLT | EUR | 0 | 0,00 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 31 417 276 | 8,37 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>31 417 276</i> | <i>8,37</i> |
| 45 362,47 | BNP PARIBAS FUNDS EURO HIGH YIELD BOND - X CAP | EUR | 7 957 938 | 2,12 |
| 43 218,90 | BNP PARIBAS FUNDS EURO HIGH YIELD SHORT DURATION BOND - I CAP | EUR | 5 435 641 | 1,44 |
| 127 223,55 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - I CAP | EUR | 18 023 697 | 4,81 |
| | Total portefeuille-titres | | 365 026 838 | 97,61 |

BNP PARIBAS FUNDS Europe Convertible

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 915 685 | 1,46 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>915 685</i> | <i>1,46</i> | | | | | |
| 11 261 | BUREAU VERITAS SA | EUR | 257 539 | 0,41 | | | | | |
| 12 666 | CARREFOUR SA | EUR | 209 812 | 0,33 | | | | | |
| 2 500 | EDENRED | EUR | 135 350 | 0,22 | | | | | |
| 1 306 | PERNOD RICARD SA | EUR | 208 634 | 0,33 | | | | | |
| 1 694 | TOTAL SA | EUR | 104 350 | 0,17 | | | | | |
| | Obligations convertibles | | 60 843 547 | 97,02 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>15 725 073</i> | <i>25,08</i> | | | | | |
| 16 674 | ACCOR 0,700% 20-07/12/2027 CV FLAT | EUR | 796 917 | 1,27 | | | | | |
| 400 000 | AIR FRANCE-KLM 22-23/02/2171 CV FRN | EUR | 457 664 | 0,73 | | | | | |
| 800 000 | ATOS SE 0,000% 19-06/11/2024 CV | EUR | 639 264 | 1,02 | | | | | |
| 700 000 | BNP PARIBAS 0,000% 22-13/05/2025 CV | EUR | 839 139 | 1,34 | | | | | |
| 200 000 | CARREFOUR SA 0,000% 18-27/03/2024 CV | USD | 177 863 | 0,28 | | | | | |
| 18 098 | EDENRED 0,000% 19-06/09/2024 CV | EUR | 1 094 585 | 1,75 | | | | | |
| 500 000 | ELIS SA 2,250% 22-22/09/2029 CV | EUR | 641 990 | 1,02 | | | | | |
| 7 065 | KORIAN SA 21-31/12/2061 CV FRN FLAT | EUR | 172 760 | 0,28 | | | | | |
| 900 000 | NEOEN SAS 2,875% 22-14/09/2027 CV | EUR | 837 216 | 1,34 | | | | | |
| 4 829 | NEXITY 0,875% 21-19/04/2028 CV FLAT | EUR | 190 586 | 0,30 | | | | | |
| 200 000 | ORPAR 0,000% 17-20/06/2024 CV | EUR | 199 932 | 0,32 | | | | | |
| 5 733 | SAFRAN SA 0,000% 21-01/04/2028 CV | EUR | 1 069 652 | 1,71 | | | | | |
| 9 685 | SAFRAN SA 0,875% 20-15/05/2027 CV FLAT | EUR | 1 581 454 | 2,52 | | | | | |
| 4 080 | SCHNEIDER 0,000% 20-15/06/2026 CV FLAT | EUR | 795 988 | 1,27 | | | | | |
| 700 000 | SCHNEIDER ELEC 1,970% 23-27/11/2030 CV | EUR | 754 257 | 1,20 | | | | | |
| 700 000 | SELENA 0,000% 20-25/06/2025 CV | EUR | 658 385 | 1,05 | | | | | |
| 2 498 | SOITEC 0,000% 20-01/10/2025 CV | EUR | 468 755 | 0,75 | | | | | |
| 800 000 | SPIE SA 2,000% 23-17/01/2028 CV | EUR | 830 144 | 1,32 | | | | | |
| 700 000 | UBISOFT ENTERTAI 2,375% 22-15/11/2028 CV | EUR | 682 773 | 1,09 | | | | | |
| 28 894 | VEOLIA ENVRNMT 0,000% 19-01/01/2025 CV | EUR | 897 361 | 1,43 | | | | | |
| 10 359 | VOLTALIA SA 1,000% 21-13/01/2025 CV FLAT | EUR | 303 757 | 0,48 | | | | | |
| 8 444 | WORLDLINE SA 0,000% 19-30/07/2026 CV | EUR | 755 713 | 1,21 | | | | | |
| 8 042 | WORLDLINE SA 0,000% 20-30/07/2025 CV | EUR | 878 918 | 1,40 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>12 532 227</i> | <i>19,97</i> | | | | | |
| 300 000 | BECHTLE AG 2,000% 23-08/12/2030 CV | EUR | 317 175 | 0,51 | | | | | |
| 1 400 000 | DELIVERY HERO AG 0,875% 20-15/07/2025 CV | EUR | 1 263 500 | 2,01 | | | | | |
| 800 000 | DELIVERY HERO AG 1,500% 20-15/01/2028 CV | EUR | 592 160 | 0,94 | | | | | |
| 900 000 | DELIVERY HERO AG 3,250% 23-21/02/2030 CV | EUR | 771 750 | 1,23 | | | | | |
| 1 400 000 | DEUTSCHE POST AG 0,050% 17-30/06/2025 CV | EUR | 1 368 262 | 2,18 | | | | | |
| 800 000 | DT LUFTHANSA AG 2,000% 20-17/11/2025 CV | EUR | 858 496 | 1,37 | | | | | |
| 200 000 | HELLOFRESH SE 0,750% 20-13/05/2025 CV | EUR | 188 978 | 0,30 | | | | | |
| 1 100 000 | LEG IMMOBILIEN SE 0,400% 20-30/06/2028 CV | EUR | 942 755 | 1,50 | | | | | |
| 100 000 | MORPHOSYS AG 0,625% 20-16/10/2025 CV | EUR | 83 675 | 0,13 | | | | | |
| 900 000 | MTU AERO ENGINES 0,050% 19-18/03/2027 CV | EUR | 800 118 | 1,28 | | | | | |
| 200 000 | NORDEX SE 4,250% 23-14/04/2030 CV | EUR | 197 904 | 0,32 | | | | | |
| 400 000 | RAG STIFTUNG 0,000% 20-17/06/2026 CV | EUR | 374 100 | 0,60 | | | | | |
| 800 000 | RAG STIFTUNG 1,875% 22-16/11/2029 CV | EUR | 826 672 | 1,32 | | | | | |
| 700 000 | RHEINMETALL 1,875% 23-07/02/2028 CV | EUR | 778 652 | 1,24 | | | | | |
| 700 000 | RHEINMETALL 2,250% 23-07/02/2030 CV | EUR | 797 706 | 1,27 | | | | | |
| 300 000 | TAG IMMO AG 0,625% 20-27/08/2026 CV | EUR | 262 275 | 0,42 | | | | | |
| 900 000 | TUI AG 5,000% 21-16/04/2028 CV | EUR | 874 251 | 1,39 | | | | | |
| 600 000 | ZALANDO SE 0,050% 20-06/08/2025 CV | EUR | 554 670 | 0,88 | | | | | |
| 800 000 | ZALANDO SE 0,625% 20-06/08/2027 CV | EUR | 679 128 | 1,08 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>8 434 234</i> | <i>13,42</i> | | | | | |
| 2 100 000 | AMERICA MOVIL BV 0,000% 21-02/03/2024 CV | EUR | 2 101 681 | 3,34 | | | | | |
| 300 000 | BASIC-FIT NV 1,500% 21-17/06/2028 CV | EUR | 270 303 | 0,43 | | | | | |
| 300 000 | BE SEMICONDUCTOR 1,875% 22-06/04/2029 CV | EUR | 404 097 | 0,64 | | | | | |
| 800 000 | DUFREY ONE BV 0,750% 21-30/03/2026 CV | CHF | 808 992 | 1,29 | | | | | |
| 400 000 | ENCAVIS FINANCE 21-31/12/2061 CV FRN | EUR | 365 188 | 0,58 | | | | | |
| 300 000 | JUST EAT TAKEA 0,000% 21-09/08/2025 CV | EUR | 271 218 | 0,43 | | | | | |
| 1 000 000 | JUST EAT TAKEA 0,625% 21-09/02/2028 CV | EUR | 748 500 | 1,19 | | | | | |
| 700 000 | JUST EAT TAKEA 1,250% 20-30/04/2026 CV | EUR | 607 880 | 0,97 | | | | | |
| 600 000 | QIAGEN NV 0,000% 20-17/12/2027 CV | USD | 489 875 | 0,78 | | | | | |
| 1 000 000 | QIAGEN NV 1,000% 18-13/11/2024 CV | USD | 927 841 | 1,48 | | | | | |
| 900 000 | SIMON GLOBAL DEV 3,500% 23-14/11/2026 CV | EUR | 941 184 | 1,50 | | | | | |
| 500 000 | TAKEAWAY.COM N 2,250% 19-25/01/2024 CV | EUR | 497 475 | 0,79 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>6 383 791</i> | <i>10,20</i> | | | | | |
| 600 000 | DIASORIN 0,000% 21-05/05/2028 CV | EUR | 492 762 | 0,79 | | | | | |
| 1 200 000 | ENI SPA 2,950% 23-14/09/2030 CV | EUR | 1 259 136 | 2,01 | | | | | |
| 1 000 000 | NEXI 0,000% 21-24/02/2028 CV | EUR | 864 160 | 1,38 | | | | | |
| 1 100 000 | NEXI 1,750% 20-24/04/2027 CV | EUR | 1 019 755 | 1,63 | | | | | |
| 500 000 | PIRELLI & C SPA 0,000% 20-22/12/2025 CV | EUR | 493 120 | 0,79 | | | | | |
| 900 000 | PRYSMIAN SPA 0,000% 21-02/02/2026 CV | EUR | 991 962 | 1,58 | | | | | |
| 800 000 | SAIPEM SPA 2,875% 23-11/09/2029 CV | EUR | 858 176 | 1,37 | | | | | |
| 400 000 | SNAM 3,250% 23-29/09/2028 CV | EUR | 404 720 | 0,65 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>4 816 530</i> | <i>7,68</i> | | | | | |
| 800 000 | AMADEUS IT GROUP 1,500% 20-09/04/2025 CV | EUR | 984 264 | 1,57 | | | | | |
| 1 000 000 | CELLNEX TELECOM 0,500% 19-05/07/2028 CV | EUR | 1 064 400 | 1,70 | | | | | |
| 1 000 000 | CELLNEX TELECOM 0,750% 20-20/11/2031 CV | EUR | 830 730 | 1,32 | | | | | |
| 1 200 000 | CELLNEX TELECOM 2,125% 23-11/08/2030 CV | EUR | 1 232 796 | 1,97 | | | | | |
| 700 000 | IBERDROLA FIN SA 0,800% 22-07/12/2027 CV | EUR | 704 340 | 1,12 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>3 477 433</i> | <i>5,56</i> | | | | | |
| 400 000 | BARCLAYS BK PLC 0,000% 22-24/01/2025 CV | EUR | 392 148 | 0,63 | | | | | |
| 1 200 000 | INTERNATIONAL CONSOLIDAT 1,125% 21-18/05/2028 CV | EUR | 1 064 160 | 1,70 | | | | | |
| 1 200 000 | OCADO GROUP PLC 0,750% 20-18/01/2027 CV | GBP | 1 082 749 | 1,73 | | | | | |
| 900 000 | WH SMITH 1,625% 21-07/05/2026 CV | GBP | 938 376 | 1,50 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>3 081 468</i> | <i>4,91</i> | | | | | |
| 500 000 | JP MORGAN CHASE 0,000% 21-10/06/2024 CV | EUR | 510 660 | 0,81 | | | | | |
| 900 000 | JP MORGAN CHASE 0,000% 21-18/02/2024 CV | EUR | 1 001 106 | 1,60 | | | | | |
| 900 000 | JP MORGAN CHASE FIN 0,000% 22-14/01/2025 CV | EUR | 904 230 | 1,44 | | | | | |
| 600 000 | JP MORGAN CHASE FIN 0,000% 22-29/04/2025 CV | EUR | 665 472 | 1,06 | | | | | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>1 961 403</i> | <i>3,13</i> | | | | | |
| 1 000 000 | STMICROELECTRON 0,000% 20-04/08/2025 CV | USD | 1 090 481 | 1,74 | | | | | |
| 800 000 | STMICROELECTRON 0,000% 20-04/08/2027 CV | USD | 870 922 | 1,39 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Europe Convertible

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>1 423 206</i> | <i>2,27</i> |
| 300 000 | CITIGROUP GLOB L 0,000% 23-15/03/2028 CV | EUR | 331 782 | 0,53 |
| 600 000 | IWG GROUP 0,500% 20-09/12/2027 CV | GBP | 601 239 | 0,96 |
| 500 000 | LAGFIN 3,500% 23-08/06/2028 CV | EUR | 490 185 | 0,78 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>984 860</i> | <i>1,57</i> |
| 1 000 000 | AMS AG 2,125% 20-03/11/2027 CV | EUR | 788 920 | 1,26 |
| 200 000 | VOESTALPINE AG 2,750% 23-28/04/2028 CV | EUR | 195 940 | 0,31 |
| | <i>Mexique</i> | | <i>699 244</i> | <i>1,12</i> |
| 700 000 | FEMSA 2,625% 23-24/02/2026 CV | EUR | 699 244 | 1,12 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>586 302</i> | <i>0,93</i> |
| 600 000 | GN STORE NORD 0,000% 19-21/05/2024 CV | EUR | 586 302 | 0,93 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>467 655</i> | <i>0,75</i> |
| 500 000 | UMICORE SA 0,000% 20-23/06/2025 CV | EUR | 467 655 | 0,75 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>202 246</i> | <i>0,32</i> |
| 200 000 | GLANBIA COOP SOC 1,875% 22-27/01/2027 CV | EUR | 202 246 | 0,32 |
| | <i>Ile de Jersey</i> | | <i>67 875</i> | <i>0,11</i> |
| 100 000 | CORNWALL JERSEY 0,750% 21-16/04/2026 CV | GBP | 67 875 | 0,11 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 182 372 | 0,29 |
| | <i>France</i> | | <i>182 372</i> | <i>0,29</i> |
| 3,55 | BNP PARIBAS CASH INVEST R | EUR | 182 372 | 0,29 |
| | Total portefeuille-titres | | 61 941 604 | 98,77 |

BNP PARIBAS FUNDS Europe Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 897 738 429 | 99,83 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>230 057 126</i> | <i>25,58</i> | | | | | |
| 146 488 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 25 799 467 | 2,87 | 270 590 | EUROFINS SCIENTIFIC | EUR | 15 959 398 | 1,77 |
| 628 581 | ALSTOM | EUR | 7 656 117 | 0,85 | | <i>Portugal</i> | | <i>13 389 696</i> | <i>1,49</i> |
| 1 670 602 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 21 470 577 | 2,39 | 581 150 | JERONIMO MARTINS | EUR | 13 389 696 | 1,49 |
| 147 902 | ESSILORLUXOTTICA | EUR | 26 859 003 | 2,99 | | <i>Norvège</i> | | <i>10 266 469</i> | <i>1,14</i> |
| 33 023 | KERING | EUR | 13 176 177 | 1,47 | 393 624 | SCHIBSTED ASA - A | NOK | 10 266 469 | 1,14 |
| 54 746 | LOREAL | EUR | 24 671 285 | 2,74 | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 1 650 078 | 0,18 |
| 36 344 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 26 661 958 | 2,96 | | <i>Luxembourg</i> | | <i>1 650 078</i> | <i>0,18</i> |
| 674 055 | MICHELIN (CGDE) | EUR | 21 879 825 | 2,43 | 13 387,89 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 1 650 078 | 0,18 |
| 108 800 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 19 777 664 | 2,20 | | Total portefeuille-titres | | 899 388 507 | 100,01 |
| 514 138 | TOTAL SA | EUR | 31 670 901 | 3,52 | | | | | |
| 665 868 | WORLDLINE SA - W/I | EUR | 10 434 152 | 1,16 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>98 820 782</i> | <i>10,99</i> | | | | | |
| 229 490 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 28 072 171 | 3,12 | | | | | |
| 59 214 | LINDE PLC | EUR | 21 870 691 | 2,43 | | | | | |
| 1 851 966 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 18 960 986 | 2,11 | | | | | |
| 329 476 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 20 607 696 | 2,29 | | | | | |
| 1 210 159 | STANDARD CHARTERED PLC | GBP | 9 309 238 | 1,04 | | | | | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>95 937 771</i> | <i>10,66</i> | | | | | |
| 224 713 | ALCON INC | CHF | 15 865 506 | 1,76 | | | | | |
| 175 032 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 16 102 944 | 1,79 | | | | | |
| 26 486 | LONZA GROUP AG - REG | CHF | 10 076 474 | 1,12 | | | | | |
| 329 151 | NESTLE SA-REG | CHF | 34 522 442 | 3,84 | | | | | |
| 428 454 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 19 370 405 | 2,15 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>90 050 797</i> | <i>10,02</i> | | | | | |
| 72 076 | ASML HOLDING NV | EUR | 49 134 208 | 5,47 | | | | | |
| 773 022 | PROSUS NV | EUR | 20 859 999 | 2,32 | | | | | |
| 777 086 | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | EUR | 20 056 590 | 2,23 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>85 965 477</i> | <i>9,58</i> | | | | | |
| 78 415 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 14 624 398 | 1,63 | | | | | |
| 941 627 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 20 480 387 | 2,28 | | | | | |
| 227 453 | SIEMENS AG - REG | EUR | 38 648 814 | 4,31 | | | | | |
| 122 560 | SYMRISE AG | EUR | 12 211 878 | 1,36 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>59 428 896</i> | <i>6,60</i> | | | | | |
| 190 467 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 12 357 499 | 1,37 | | | | | |
| 7 496 923 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 28 334 620 | 3,15 | | | | | |
| 1 212 344 | GRIFOLS SA | EUR | 18 736 777 | 2,08 | | | | | |
| | <i>Danemark</i> | | <i>57 186 885</i> | <i>6,37</i> | | | | | |
| 504 017 | NOVO NORDISK A/S-B | DKK | 47 199 934 | 5,26 | | | | | |
| 200 615 | NOVOZYMES A/S - B | DKK | 9 986 951 | 1,11 | | | | | |
| | <i>Finlande</i> | | <i>42 162 811</i> | <i>4,68</i> | | | | | |
| 718 522 | NESTE OYJ | EUR | 23 143 594 | 2,57 | | | | | |
| 480 162 | SAMPO OYJ - A | EUR | 19 019 217 | 2,11 | | | | | |
| | <i>Suède</i> | | <i>36 413 353</i> | <i>4,05</i> | | | | | |
| 1 339 429 | ATLAS COPCO AB-A | SEK | 20 881 015 | 2,32 | | | | | |
| 855 162 | EPIROC AB-A | SEK | 15 532 338 | 1,73 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>24 834 596</i> | <i>2,76</i> | | | | | |
| 9 394 589 | INTESA SANPAOLO | EUR | 24 834 596 | 2,76 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>20 177 866</i> | <i>2,24</i> | | | | | |
| 546 069 | EXPERIAN PLC | GBP | 20 177 866 | 2,24 | | | | | |
| | <i>Belgique</i> | | <i>17 086 506</i> | <i>1,90</i> | | | | | |
| 292 477 | ANHEUSER - BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 17 086 506 | 1,90 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Europe Growth

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 119 837 498 | 99,67 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>24 757 226</i> | <i>20,59</i> | | <i>Portugal</i> | | <i>1 792 742</i> | <i>1,49</i> |
| 83 635 | ALSTOM | EUR | 1 018 674 | 0,85 | 77 810 | JERONIMO MARTINS | EUR | 1 792 742 | 1,49 |
| 22 589 | ESSILORLUXOTTICA | EUR | 4 102 162 | 3,41 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 5 596 | KERING | EUR | 2 232 804 | 1,86 | | | | 125 452 | 0,10 |
| 11 319 | LOREAL | EUR | 5 100 907 | 4,24 | | <i>Luxembourg</i> | | <i>125 452</i> | <i>0,10</i> |
| 6 700 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 4 915 120 | 4,09 | 1 017,86 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 125 452 | 0,10 |
| 10 512 | SARTORIUS STEDIM BIOTECH | EUR | 2 517 624 | 2,09 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 16 036 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 2 915 024 | 2,42 | | | | 119 962 950 | 99,77 |
| 124 755 | WORLDFLINE SA - W/I | EUR | 1 954 911 | 1,63 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>16 294 005</i> | <i>13,54</i> | | | | | |
| 25 804 | CTS EVENTIM AG + CO KGAA | EUR | 1 615 330 | 1,34 | | | | | |
| 165 799 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 3 606 128 | 3,00 | | | | | |
| 27 701 | SAP SE | EUR | 3 863 735 | 3,21 | | | | | |
| 30 372 | SIEMENS AG - REG | EUR | 5 160 811 | 4,29 | | | | | |
| 20 554 | SYMRISE AG | EUR | 2 048 001 | 1,70 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>16 241 548</i> | <i>13,51</i> | | | | | |
| 10 637 | ASML HOLDING NV | EUR | 7 251 244 | 6,03 | | | | | |
| 119 458 | CTP NV | EUR | 1 825 318 | 1,52 | | | | | |
| 141 681 | PROSUS NV | EUR | 3 823 262 | 3,18 | | | | | |
| 129 474 | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | EUR | 3 341 724 | 2,78 | | | | | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>15 666 690</i> | <i>13,03</i> | | | | | |
| 44 520 | ALCON INC | CHF | 3 143 264 | 2,61 | | | | | |
| 32 162 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 2 958 904 | 2,46 | | | | | |
| 4 763 | LONZA GROUP AG - REG | CHF | 1 812 061 | 1,51 | | | | | |
| 47 243 | NESTLE SA-REG | CHF | 4 955 002 | 4,12 | | | | | |
| 61 877 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 2 797 459 | 2,33 | | | | | |
| | <i>Danemark</i> | | <i>9 268 227</i> | <i>7,71</i> | | | | | |
| 75 756 | NOVO NORDISK A/S-B | DKK | 7 094 361 | 5,90 | | | | | |
| 43 668 | NOVOZYMES A/S - B | DKK | 2 173 866 | 1,81 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>7 621 159</i> | <i>6,34</i> | | | | | |
| 12 391 | LINDE PLC | EUR | 4 576 616 | 3,81 | | | | | |
| 297 368 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 3 044 543 | 2,53 | | | | | |
| | <i>Suède</i> | | <i>5 942 270</i> | <i>4,94</i> | | | | | |
| 244 688 | ATLAS COPCO AB-A | SEK | 3 814 561 | 3,17 | | | | | |
| 117 145 | EPIROC AB-A | SEK | 2 127 709 | 1,77 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>5 651 610</i> | <i>4,71</i> | | | | | |
| 35 868 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 2 327 116 | 1,94 | | | | | |
| 215 108 | GRIFOLS SA | EUR | 3 324 494 | 2,77 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>3 246 267</i> | <i>2,70</i> | | | | | |
| 87 853 | EXPERIAN PLC | GBP | 3 246 267 | 2,70 | | | | | |
| | <i>Finlande</i> | | <i>3 202 061</i> | <i>2,66</i> | | | | | |
| 99 412 | NESTE OYJ | EUR | 3 202 061 | 2,66 | | | | | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>2 991 392</i> | <i>2,49</i> | | | | | |
| 298 567 | ADEVINTA ASA | NOK | 2 991 392 | 2,49 | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>2 533 545</i> | <i>2,11</i> | | | | | |
| 42 956 | EUROFINS SCIENTIFIC | EUR | 2 533 545 | 2,11 | | | | | |
| | <i>Pologne</i> | | <i>2 497 724</i> | <i>2,08</i> | | | | | |
| 325 566 | ALLEGRO.EU SA | PLN | 2 497 724 | 2,08 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>2 131 032</i> | <i>1,77</i> | | | | | |
| 287 744 | NEXI SPA | EUR | 2 131 032 | 1,77 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Europe High Conviction Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 162 934 914 | 52,68 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 3 000 000 | ABEILLE VIE 6,250% 22-09/09/2033 | EUR | 3 258 460 | 1,05 | | | | | |
| 4 500 000 | ALTAREA 1,750% 20-16/01/2030 | EUR | 3 454 716 | 1,12 | | | | | |
| 6 000 000 | BOUYGUES SA 5,375% 22-30/06/2042 | EUR | 7 110 194 | 2,30 | | | | | |
| 2 200 000 | COFACE SA 5,750% 23-28/11/2033 | EUR | 2 279 507 | 0,74 | | | | | |
| 1 000 000 | COFACE SA 6,000% 22-22/09/2032 | EUR | 1 064 867 | 0,34 | | | | | |
| 1 000 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 5,875% 23-25/10/2033 | EUR | 1 096 140 | 0,35 | | | | | |
| 6 500 000 | ELEC DE FRANCE 4,625% 23-25/01/2043 | EUR | 6 828 880 | 2,21 | | | | | |
| 1 000 000 | ELEC DE FRANCE 6,000% 14-23/01/2114 | GBP | 1 121 987 | 0,36 | | | | | |
| 1 400 000 | ENGIE 4,250% 23-11/01/2043 | EUR | 1 464 080 | 0,47 | | | | | |
| 3 000 000 | FRANCE TELECOM 5,375% 10-22/11/2050 | GBP | 3 750 470 | 1,21 | | | | | |
| 500 000 | IXIS CIB 5,400% 03-09/01/2033 | EUR | 531 460 | 0,17 | | | | | |
| 3 000 000 | LA MONDIALE 2,125% 20-23/06/2031 | EUR | 2 577 564 | 0,83 | | | | | |
| 1 000 000 | MERCIALYS 2,000% 17-03/11/2027 | EUR | 892 625 | 0,29 | | | | | |
| 1 200 000 | MERCIALYS 2,500% 22-28/02/2029 | EUR | 1 094 270 | 0,35 | | | | | |
| 5 400 000 | SOCIETE GENERALE 5,625% 23-02/06/2033 | EUR | 5 755 240 | 1,86 | | | | | |
| 2 500 000 | SOCIETE GENERALE 7,367% 23-10/01/2053 | USD | 2 386 480 | 0,77 | | | | | |
| 2 500 000 | TIKEHAU CAPITAL 1,625% 21-31/03/2029 | EUR | 2 155 435 | 0,70 | | | | | |
| 1 600 000 | UNIBAIL-RODAMCO 1,750% 19-01/07/2049 | EUR | 1 039 588 | 0,34 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | | | | | |
| 2 000 000 | ABN AMRO BANK NV 4,500% 22-21/11/2034 | EUR | 2 145 172 | 0,69 | | | | | |
| 1 500 000 | DIGITAL INTREPID 1,375% 22-18/07/2032 | EUR | 1 219 781 | 0,39 | | | | | |
| 1 000 000 | ENBW 6,125% 09-07/07/2039 | EUR | 1 284 026 | 0,42 | | | | | |
| 2 000 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 4,500% 23-20/02/2043 | EUR | 2 058 727 | 0,67 | | | | | |
| 3 500 000 | JAB HOLDINGS 2,250% 19-19/12/2039 | EUR | 2 711 700 | 0,88 | | | | | |
| 3 000 000 | JAB HOLDINGS 3,375% 20-17/04/2035 | EUR | 2 851 970 | 0,92 | | | | | |
| 4 000 000 | PROSUS NV 1,985% 21-13/07/2033 | EUR | 2 947 400 | 0,95 | | | | | |
| 2 400 000 | PROSUS NV 4,987% 22-19/01/2052 | USD | 1 621 328 | 0,52 | | | | | |
| 2 000 000 | STELLANTIS NV 1,250% 21-20/06/2033 | EUR | 1 610 160 | 0,52 | | | | | |
| 3 000 000 | STELLANTIS NV 2,750% 22-01/04/2032 | EUR | 2 801 764 | 0,91 | | | | | |
| 3 000 000 | TEVA PHARM FNC 7,875% 23-15/09/2031 | EUR | 3 392 640 | 1,10 | | | | | |
| 1 500 000 | TEVA PHARMACEUTI 4,375% 21-09/05/2030 | EUR | 1 406 010 | 0,45 | | | | | |
| 2 000 000 | VOLKSWAGEN INTFN 1,500% 21-21/01/2041 | EUR | 1 409 907 | 0,46 | | | | | |
| 2 000 000 | VOLKSWAGEN INTFN 4,125% 18-16/11/2038 | EUR | 2 067 001 | 0,67 | | | | | |
| 2 500 000 | VONOVIA BV 2,750% 18-22/03/2038 | EUR | 2 101 184 | 0,68 | | | | | |
| <i>Italie</i> | | | | | | | | | |
| 3 000 000 | 2I RETE GAS SPA 4,375% 23-06/06/2033 | EUR | 3 067 804 | 0,99 | | | | | |
| 5 000 000 | ASSICURAZIONI 5,399% 23-20/04/2033 | EUR | 5 285 094 | 1,71 | | | | | |
| 5 000 000 | AUTOSTRADA TORIN 2,375% 21-25/11/2033 | EUR | 4 192 977 | 1,36 | | | | | |
| 3 500 000 | AUTOSTRADA PER L 2,250% 22-25/01/2032 | EUR | 3 000 628 | 0,97 | | | | | |
| 1 500 000 | INTESA SANPAOLO 1,350% 21-24/02/2031 | EUR | 1 228 094 | 0,40 | | | | | |
| 2 000 000 | INTESA SANPAOLO 2,375% 20-22/12/2030 | EUR | 1 602 167 | 0,52 | | | | | |
| 2 600 000 | INTESA SANPAOLO 6,625% 23-31/05/2033 | GBP | 3 159 731 | 1,02 | | | | | |
| 3 000 000 | ITALY BTPS 2,800% 16-01/03/2067 | EUR | 2 192 400 | 0,71 | | | | | |
| 4 000 000 | ITALY BTPS 4,000% 22-30/04/2035 | EUR | 4 072 480 | 1,32 | | | | | |
| | | | | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 2 000 000 | AT&T INC 2,450% 15-15/03/2035 | EUR | 1 777 335 | 0,57 | | | | | |
| 2 000 000 | AT&T INC 2,600% 20-19/05/2038 | EUR | 1 713 947 | 0,55 | | | | | |
| 1 000 000 | AT&T INC 3,150% 17-04/09/2036 | EUR | 930 452 | 0,30 | | | | | |
| 1 000 000 | CHUBB INA HLDGS 2,500% 18-15/03/2038 | EUR | 875 027 | 0,28 | | | | | |
| 2 500 000 | COMPUTERSHARE US 1,125% 21-07/10/2031 | EUR | 1 939 892 | 0,63 | | | | | |
| 2 000 000 | FIDELITY NATIONAL IN 2,950% 19-21/05/2039 | EUR | 1 748 991 | 0,57 | | | | | |
| 3 000 000 | IBM CORP 4,000% 23-06/02/2043 | EUR | 3 114 956 | 1,01 | | | | | |
| 5 000 000 | PROLOGIS EURO 4,250% 23-31/01/2043 | EUR | 5 027 580 | 1,63 | | | | | |
| 3 500 000 | THERMO FISHER 1,875% 19-01/10/2049 | EUR | 2 495 436 | 0,81 | | | | | |
| 1 000 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1,850% 20-18/05/2040 | EUR | 785 453 | 0,25 | | | | | |
| | | | | | <i>Royaume-Uni</i> | | | | |
| 2 500 000 | BAA FUNDING LTD 4,625% 13-31/10/2046 | GBP | 2 646 903 | 0,86 | | | | | |
| 2 000 000 | MARKS & SPENCER 7,125% 07-01/12/2037 | USD | 1 827 676 | 0,59 | | | | | |
| 5 000 000 | TESCO PLC 5,125% 07-10/04/2047 | EUR | 5 547 558 | 1,79 | | | | | |
| | | | | | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 3 500 000 | BECTON DICKINSON 1,336% 21-13/08/2041 | EUR | 2 407 204 | 0,78 | | | | | |
| 500 000 | LOGICOR FIN 3,250% 18-13/11/2028 | EUR | 474 539 | 0,15 | | | | | |
| 1 500 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 0,750% 21-23/03/2033 | EUR | 1 142 564 | 0,37 | | | | | |
| 389 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 1,625% 20-17/06/2032 | EUR | 325 601 | 0,11 | | | | | |
| 4 000 000 | PROLOGIS INTERNATIONAL II 4,625% 23-21/02/2035 | EUR | 4 161 360 | 1,35 | | | | | |
| | | | | | <i>Espagne</i> | | | | |
| 2 000 000 | CELLNEX FINANCE 2,000% 21-15/02/2033 | EUR | 1 703 353 | 0,55 | | | | | |
| 4 200 000 | MERLIN PROPERTIES 1,875% 19-04/12/2034 | EUR | 3 311 164 | 1,07 | | | | | |
| 1 000 000 | TELEFONICA EMIS 1,864% 20-13/07/2040 | EUR | 779 518 | 0,25 | | | | | |
| | | | | | <i>Allemagne</i> | | | | |
| 2 000 000 | DT PFANDBRIEFBAN 4,600% 17-22/02/2027 | EUR | 1 466 900 | 0,47 | | | | | |
| 2 000 000 | LANDBK HESSEN-TH 5,375% 23-01/02/2033 | EUR | 1 861 200 | 0,60 | | | | | |
| 2 000 000 | ROBERT BOSCH 4,375% 23-02/06/2043 | EUR | 2 140 588 | 0,69 | | | | | |
| | | | | | <i>Belgique</i> | | | | |
| 3 300 000 | ETHIAS 6,750% 23-05/05/2033 | EUR | 3 397 802 | 1,10 | | | | | |
| 2 000 000 | VGP NV 2,250% 22-17/01/2030 | EUR | 1 559 807 | 0,50 | | | | | |
| | | | | | <i>Roumanie</i> | | | | |
| 600 000 | NE PROPERTY 2,000% 22-20/01/2030 | EUR | 480 000 | 0,16 | | | | | |
| Obligations à taux flottant | | | 127 031 546 | 41,09 | | | | | |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 6 000 000 | AXA SA 22-10/07/2042 FRN | EUR | 4 925 261 | 1,59 | | | | | |
| 3 000 000 | AXA SA 23-11/07/2043 FRN | EUR | 3 208 703 | 1,04 | | | | | |
| 2 000 000 | BNP PARIBAS 21-31/12/2061 FRN | USD | 1 462 164 | 0,47 | | | | | |
| 7 000 000 | BNP PARIBAS 23-11/06/2171 FRN | EUR | 7 442 261 | 2,41 | | | | | |
| 4 000 000 | BPCE 21-13/10/2046 FRN | EUR | 3 247 877 | 1,05 | | | | | |
| 1 000 000 | CNP ASSURANCES 18-31/12/2049 FRN | EUR | 970 844 | 0,31 | | | | | |
| 2 200 000 | CNP ASSURANCES 20-30/06/2051 FRN | EUR | 1 916 027 | 0,62 | | | | | |
| 2 000 000 | CNP ASSURANCES 21-31/12/2061 FRN | USD | 1 425 651 | 0,46 | | | | | |
| 2 000 000 | ELEC DE FRANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 749 680 | 0,57 | | | | | |
| 4 000 000 | GACM 21-21/04/2042 FRN | EUR | 3 228 887 | 1,04 | | | | | |
| 4 400 000 | LA BANQUE POSTALE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 3 231 492 | 1,05 | | | | | |
| 3 100 000 | MUTUELLE ASSUR 21-21/06/2052 FRN | EUR | 2 382 266 | 0,77 | | | | | |
| 2 400 000 | MUTUELLE ASSUR 21-21/12/2169 FRN | EUR | 1 784 285 | 0,58 | | | | | |
| 5 000 000 | SCOR SE 18-31/12/2049 FRN | USD | 3 654 061 | 1,18 | | | | | |
| 1 100 000 | SCOR SE 20-17/09/2051 FRN | EUR | 868 335 | 0,28 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Europe High Conviction Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 2 500 000 | SOGECAP SA 23-16/05/2044 FRN | EUR | 2 697 971 | 0,87 | | | | | |
| 1 200 000 | TOTAL SE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 006 867 | 0,33 | | | | | |
| 7 000 000 | TOTAL SE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 5 591 821 | 1,81 | | | | | |
| 3 500 000 | TOTALENERGIES SE 22-31/12/2062 FRN | EUR | 2 876 168 | 0,93 | | | | | |
| 900 000 | UNIBAIL-RODAMCO 18-31/12/2049 FRN | EUR | 789 795 | 0,26 | | | | | |
| 4 600 000 | URW 23-03/10/2171 FRN | EUR | 4 585 635 | 1,48 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>24 170 233</i> | <i>7,82</i> | | | | | |
| 1 000 000 | ACHMEA BV 19-24/03/2168 FRN | EUR | 843 584 | 0,27 | | | | | |
| 1 000 000 | ACHMEA BV 19-24/09/2039 FRN | EUR | 860 619 | 0,28 | | | | | |
| 4 000 000 | AEGON NV 95-29/06/2049 SR FRN | NLG | 1 393 112 | 0,45 | | | | | |
| 600 000 | AGEAS FINANCE 19-31/12/2059 FRN | EUR | 463 465 | 0,15 | | | | | |
| 4 000 000 | ASR NEDERLAND NV 22-07/12/2043 FRN | EUR | 4 497 832 | 1,45 | | | | | |
| 2 000 000 | COOPERATIEVE RAB 21-31/12/2061 FRN | EUR | 1 643 393 | 0,53 | | | | | |
| 900 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 762 437 | 0,25 | | | | | |
| 4 000 000 | ING GROEP NV 23/05/2034 FRN | EUR | 4 252 740 | 1,38 | | | | | |
| 4 000 000 | NN GROUP NV 23-03/11/2043 FRN | EUR | 4 260 379 | 1,38 | | | | | |
| 1 000 000 | TELEFONICA EUROP 21-31/12/2061 FRN | EUR | 867 339 | 0,28 | | | | | |
| 800 000 | VOLKSWAGEN INTFN 15-29/12/2049 FRN | EUR | 714 136 | 0,23 | | | | | |
| 4 000 000 | VOLKSWAGEN INTFN 22-28/03/2171 FRN | EUR | 3 611 197 | 1,17 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>14 361 134</i> | <i>4,64</i> | | | | | |
| 6 400 000 | ALLIANZ SE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 4 633 179 | 1,50 | | | | | |
| 1 000 000 | ALLIANZ SE 22-05/07/2052 FRN | EUR | 988 575 | 0,32 | | | | | |
| 3 000 000 | DEUTSCHE BANK AG 20-19/11/2030 FRN | EUR | 2 604 873 | 0,84 | | | | | |
| 2 500 000 | DEUTSCHE BANK AG 21-17/02/2032 FRN | EUR | 2 052 184 | 0,66 | | | | | |
| 500 000 | ENERGIE BADEN-WU 21-31/08/2081 FRN | EUR | 388 292 | 0,13 | | | | | |
| 2 500 000 | HANNOVER RUECKV 22-26/08/2043 FRN | EUR | 2 785 359 | 0,90 | | | | | |
| 1 100 000 | TALANX AG 21-01/12/2042 FRN | EUR | 908 672 | 0,29 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>11 085 386</i> | <i>3,59</i> | | | | | |
| 2 000 000 | AVIVA PLC 20-03/06/2055 FRN | GBP | 1 895 617 | 0,61 | | | | | |
| 2 000 000 | BARCLAYS BANK PLC 21-12/05/2032 FRN | EUR | 1 627 083 | 0,53 | | | | | |
| 4 000 000 | SWISS RE FIN UK 20-04/06/2052 FRN | EUR | 3 543 161 | 1,15 | | | | | |
| 4 500 000 | VODAFONE GROUP 20-27/08/2080 FRN | EUR | 4 019 525 | 1,30 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>9 347 617</i> | <i>3,03</i> | | | | | |
| 3 000 000 | ENEL SPA 23-16/07/2171 FRN | EUR | 3 188 663 | 1,03 | | | | | |
| 2 000 000 | ENI SPA 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 824 703 | 0,59 | | | | | |
| 1 000 000 | ENI SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 854 337 | 0,28 | | | | | |
| 4 269 000 | POSTE ITALIANE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 3 479 914 | 1,13 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>2 537 209</i> | <i>0,82</i> | | | | | |
| 2 400 000 | CAIXABANK 23-13/06/2171 FRN | EUR | 2 537 209 | 0,82 | | | | | |
| | <i>Autriche</i> | | <i>2 105 592</i> | <i>0,68</i> | | | | | |
| 600 000 | RAIFFEISEN BK IN 21-17/06/2033 FRN | EUR | 490 139 | 0,16 | | | | | |
| 2 000 000 | UNIQA INSURANCE 21-09/12/2041 FRN | EUR | 1 615 453 | 0,52 | | | | | |
| | <i>Finlande</i> | | <i>1 676 401</i> | <i>0,54</i> | | | | | |
| 2 000 000 | SAMPO OYJ 20-03/09/2052 FRN | EUR | 1 676 401 | 0,54 | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>1 299 860</i> | <i>0,41</i> | | | | | |
| 1 000 000 | AROUNDTOWN SA 18-31/12/2049 FRN | EUR | 351 000 | 0,11 | | | | | |
| 1 000 000 | CPI PROPERTY GRO 20-31/12/2060 FRN | EUR | 288 860 | 0,09 | | | | | |
| 3 000 000 | CPI PROPERTY GRO 21-31/12/2061 FRN | EUR | 660 000 | 0,21 | | | | | |
| | <i>Belgique</i> | | <i>1 195 743</i> | <i>0,39</i> | | | | | |
| 1 500 000 | AGEAS 20-24/11/2051 FRN | EUR | 1 195 743 | 0,39 | | | | | |
| | | | | | | <i>Suède</i> | | <i>206 320</i> | <i>0,07</i> |
| | | | | | 600 000 | HEIMSTADEN BOSTA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 206 320 | 0,07 |
| | | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 11 905 786 | 3,86 |
| | | | | | | <i>France</i> | | <i>11 905 510</i> | <i>3,86</i> |
| | | | | | 500,60 | BNP PARIBAS INVEST 3 MOIS - CLASSIC CAP | EUR | 11 905 510 | 3,86 |
| | | | | | | <i>Luxembourg</i> | | <i>276</i> | <i>0,00</i> |
| | | | | | 1,87 | BNP PARIBAS FUNDS EURO INFLATION-LINKED BOND - CLASSIC CAP | EUR | 276 | 0,00 |
| | | | | | | Total portefeuille-titres | | 301 872 246 | 97,63 |

BNP PARIBAS FUNDS Europe Real Estate Securities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 107 777 416 | 98,03 |
| Actions | | | 107 777 416 | 98,03 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | <i>23 775 313</i> | <i>21,61</i> |
| 1 290 540 | GRAINGER PLC | GBP | 3 937 670 | 3,58 |
| 540 134 | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | GBP | 2 617 925 | 2,38 |
| 580 208 | LAND SECURITIES GROUP PLC | GBP | 4 719 065 | 4,29 |
| 722 195 | SEGRO PLC | GBP | 7 387 382 | 6,71 |
| 855 998 | SHAFTESBURY CAPITAL PLC | GBP | 1 364 184 | 1,24 |
| 311 185 | UNITE GROUP PLC | GBP | 3 749 087 | 3,41 |
| <i>France</i> | | | <i>19 977 386</i> | <i>18,17</i> |
| 18 214 | ARGAN | EUR | 1 551 833 | 1,41 |
| 73 760 | CARMILA | EUR | 1 149 181 | 1,05 |
| 74 456 | COVIVIO | EUR | 3 624 518 | 3,30 |
| 62 018 | GECINA SA | EUR | 6 828 182 | 6,21 |
| 49 587 | ICADE | EUR | 1 762 322 | 1,60 |
| 205 079 | KLEPIERRE | EUR | 5 061 350 | 4,60 |
| <i>Allemagne</i> | | | <i>15 828 094</i> | <i>14,39</i> |
| 82 849 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 6 571 583 | 5,98 |
| 284 724 | VONOVIA SE | EUR | 8 165 883 | 7,42 |
| 38 214 | VONOVIA SE | EUR | 1 090 628 | 0,99 |
| <i>Suède</i> | | | <i>10 646 620</i> | <i>9,69</i> |
| 428 512 | CASTELLUM AB | SEK | 5 515 901 | 5,02 |
| 211 971 | HUFVUDSTADEN AB - A | SEK | 2 705 689 | 2,46 |
| 179 499 | PANDOX AB - W/I | SEK | 2 425 030 | 2,21 |
| <i>Belgique</i> | | | <i>9 671 424</i> | <i>8,80</i> |
| 40 879 | AEDIFICA | EUR | 2 601 948 | 2,37 |
| 29 410 | COFINIMMO | EUR | 2 099 874 | 1,91 |
| 174 372 | WAREHOUSES DE PAUW SCA | EUR | 4 969 602 | 4,52 |
| <i>Suisse</i> | | | <i>9 288 302</i> | <i>8,45</i> |
| 42 828 | PSP SWISS PROPERTY AG - REG | CHF | 5 417 417 | 4,93 |
| 40 053 | SWISS PRIME SITE - REG | CHF | 3 870 885 | 3,52 |
| <i>Espagne</i> | | | <i>9 002 681</i> | <i>8,19</i> |
| 709 893 | INMOBILIARIA COL SOCIMI | EUR | 4 649 799 | 4,23 |
| 432 692 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | EUR | 4 352 882 | 3,96 |
| <i>Pays-Bas</i> | | | <i>6 549 193</i> | <i>5,96</i> |
| 97 866 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | EUR | 6 549 193 | 5,96 |
| <i>Autriche</i> | | | <i>1 732 798</i> | <i>1,58</i> |
| 53 399 | CA IMMOBILIEN ANLAGEN AG | EUR | 1 732 798 | 1,58 |
| <i>Ile de Guernesey</i> | | | <i>1 305 605</i> | <i>1,19</i> |
| 29 104 | SHURGARD SELF STORAGE LTD | EUR | 1 305 605 | 1,19 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 1 100 972 | 1,00 |
| <i>Luxembourg</i> | | | <i>1 100 972</i> | <i>1,00</i> |
| 8 932,73 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 1 100 972 | 1,00 |
| Total portefeuille-titres | | | 108 878 388 | 99,03 |

BNP PARIBAS FUNDS Europe Small Cap

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|-----------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 154 624 | COMPUTACENTER PLC | GBP | 4 981 942 | 1,09 | 12 311 | FISCHER (GEORG)-REG | CHF | 809 080 | 0,18 |
| 2 830 831 | CONVATEC GROUP PLC | GBP | 7 977 485 | 1,74 | 50 911 | LANDIS+GYR GROUP AG | CHF | 4 161 811 | 0,91 |
| 60 571 | CVS GROUP PLC | GBP | 1 176 401 | 0,26 | 36 939 | PSP SWISS PROPERTY AG - REG | CHF | 4 672 503 | 1,02 |
| 690 687 | DISCOVERIE GROUP PLC | GBP | 6 296 725 | 1,37 | 9 454 | SIEGFRIED HOLDING AG - REG | CHF | 8 740 145 | 1,91 |
| 3 656 917 | GRAINER PLC | GBP | 11 157 912 | 2,44 | 211 352 | SIG COMBIBLOC GROUP AG | CHF | 4 398 904 | 0,96 |
| 273 097 | GREGGS PLC | GBP | 8 200 316 | 1,79 | 33 256 | SWISSQUOTE GROUP HOLDING-REG | CHF | 7 318 681 | 1,60 |
| 382 029 | HOWDEN JOINERY GROUP PLC | GBP | 3 586 854 | 0,78 | 5 115 | TECAN GROUP AG-REG | CHF | 1 889 309 | 0,41 |
| 1 328 812 | IG GROUP HOLDINGS PLC | GBP | 11 738 568 | 2,56 | <i>Espagne</i> | | | | |
| 1 018 653 | INCHCAPE PLC | GBP | 8 410 896 | 1,84 | 849 401 | BANKINTER SA | EUR | 4 923 128 | 1,07 |
| 652 445 | INTERMEDIATE CAPITAL GROUP | GBP | 12 652 863 | 2,77 | 719 497 | INDRA SISTEMAS SA | EUR | 10 072 958 | 2,20 |
| 1 335 467 | MAN GROUP PLC/JERSEY | GBP | 3 584 671 | 0,78 | 1 243 513 | INMOBILIARIA COL SOCIMI | EUR | 8 145 010 | 1,78 |
| 2 360 674 | MARKS & SPENCER GROUP PLC | GBP | 7 420 779 | 1,62 | 358 874 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | EUR | 3 610 272 | 0,79 |
| 146 021 | MICHAEL PAGE INTERNATIONAL | GBP | 820 636 | 0,18 | 91 592 | VISCOFAN SA | EUR | 4 909 331 | 1,07 |
| 1 898 439 | PETS AT HOME GROUP PLC | GBP | 6 971 130 | 1,52 | <i>Autriche</i> | | | | |
| 77 316 | SAFESTORE HOLDINGS PLC | GBP | 788 729 | 0,17 | 92 900 | ANDRITZ AG | EUR | 5 239 560 | 1,14 |
| 125 911 | SPECTRIS PLC | GBP | 5 490 943 | 1,20 | 206 203 | BAWAG GROUP AG | EUR | 9 893 620 | 2,16 |
| 565 096 | WEIR GROUP PLC/THE | GBP | 12 302 275 | 2,69 | 205 271 | WIENERBERGER AG | EUR | 6 203 290 | 1,35 |
| 94 617 | WH SMITH PLC | GBP | 1 456 570 | 0,32 | <i>Irlande</i> | | | | |
| 99 384 | YOUNG PLC | GBP | 1 353 334 | 0,30 | 708 117 | GLANBIA PLC | EUR | 10 558 024 | 2,30 |
| <i>France</i> | | | | | 433 997 | GRAFTON GROUP PLC - UTS | GBP | 4 563 091 | 1,00 |
| 625 970 | ELIS SA - W/I | EUR | 11 824 573 | 2,58 | <i>Danemark</i> | | | | |
| 70 918 | GAZTRANSPORT ET TECHNIGA SA | EUR | 8 503 068 | 1,86 | 120 454 | ALK-ABELLO A/S | DKK | 1 635 236 | 0,36 |
| 60 439 | IPSOS | EUR | 3 429 913 | 0,75 | 562 687 | H LUNDBECK A/S | DKK | 2 472 802 | 0,54 |
| 151 216 | REXEL SA | EUR | 3 745 620 | 0,82 | 59 655 | NKT A/S | DKK | 3 711 557 | 0,81 |
| 14 261 | S.O.I.T.E.C. | EUR | 2 307 430 | 0,50 | 66 874 | ROYAL UNIBREW | DKK | 4 046 772 | 0,88 |
| 59 056 | SOPRA STERIA GROUP | EUR | 11 681 277 | 2,55 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 393 632 | SPIE SA - W/I | EUR | 11 139 786 | 2,43 | 1 832 903 | B&M EUROPEAN VALUE RETAIL SA | GBP | 11 849 198 | 2,59 |
| 19 881 | VERALLIA | EUR | 693 052 | 0,15 | <i>Norvège</i> | | | | |
| <i>Suède</i> | | | | | 2 784 708 | AKER SOLUTIONS ASA | NOK | 10 430 399 | 2,28 |
| 185 870 | AAK AB | SEK | 3 753 297 | 0,82 | <i>Finlande</i> | | | | |
| 364 609 | AXFOOD AB | SEK | 8 941 231 | 1,95 | 195 086 | HUHTAMAKI OYJ | EUR | 7 165 509 | 1,56 |
| 945 290 | CASTELLUM AB | SEK | 12 167 982 | 2,66 | 114 433 | VALMET OYJ | EUR | 2 987 846 | 0,65 |
| 1 027 635 | FABEGE AB | SEK | 9 987 883 | 2,18 | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 80 695 | HEXPOL AB | SEK | 884 329 | 0,19 | 19 117 | AALBERTS INDUSTRIES NV | EUR | 750 533 | 0,16 |
| 87 311 | LINDAB INTERNATIONAL AB | SEK | 1 561 520 | 0,34 | 98 283 | ARCADIS NV | EUR | 4 800 142 | 1,05 |
| 390 803 | LOOMIS AB | SEK | 9 394 016 | 2,05 | <i>Belgique</i> | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | 50 868 | MELEXIS NV | EUR | 4 641 705 | 1,01 |
| 153 683 | AIXTRON SE | EUR | 5 941 385 | 1,30 | Autres valeurs mobilières | | | | |
| 28 828 | CTS EVENTIM AG + CO KGAA | EUR | 1 804 633 | 0,39 | | | | | |
| 435 561 | FREENET AG | EUR | 11 037 116 | 2,41 | Actions | | | | |
| 68 541 | GERRESHEIMER AG | EUR | 6 466 843 | 1,41 | <i>Emirats Arabes Unis</i> | | | | |
| 148 644 | HUGO BOSS AG - ORD | EUR | 10 027 524 | 2,19 | 422 910 | NMC HEALTH PLC | GBP | 0 | 0,00 |
| 170 726 | JENOPTIK AG | EUR | 4 855 447 | 1,06 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| <i>Italie</i> | | | | | | | | | |
| 270 364 | AZIMUT HOLDING SPA | EUR | 6 391 405 | 1,40 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 332 027 | BANCA GENERALI S.P.A. | EUR | 11 169 388 | 2,44 | 88 257,76 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - X CAP | EUR | 10 877 901 | 2,37 |
| 86 556 | BRUNELLO CUCINELLI SPA | EUR | 7 668 862 | 1,67 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 201 101 | INTERPUMP GROUP SPA | EUR | 9 425 604 | 2,06 | 458 122 333 100,01 | | | | |
| 68 953 | IVECO GROUP NV | EUR | 561 691 | 0,12 | | | | | |
| 7 616 | REPLY SPA | EUR | 910 112 | 0,20 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Europe Small Cap Convertible

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|---|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations convertibles | | | 202 011 285 | 97,79 | | | | | |
| Pays-Bas | | | | | | | | | |
| 3 500 000 | BASIC-FIT NV 1,500% 21-17/06/2028 CV | EUR | 3 153 535 | 1,53 | | | | | |
| 6 100 000 | BE SEMICONDUCTOR 1,875% 22-06/04/2029 CV | EUR | 8 216 639 | 3,98 | | | | | |
| 4 100 000 | CM.COM NV 2,000% 21-09/09/2026 CV | EUR | 2 603 828 | 1,26 | | | | | |
| 1 800 000 | ELM BV SWISS PRI 1,625% 23-31/05/2030 CV | CHF | 2 089 913 | 1,01 | | | | | |
| 7 000 000 | ENCAVIS FINANCE 21-31/12/2061 CV FRN | EUR | 6 390 790 | 3,09 | | | | | |
| 1 000 000 | FUGRO NV 4,500% 17-02/11/2024 CV | EUR | 1 015 310 | 0,49 | | | | | |
| 7 400 000 | JUST EAT TAKEA 1,250% 20-30/04/2026 CV | EUR | 6 426 160 | 3,11 | | | | | |
| 1 400 000 | MONDELEZ INTL 0,000% 21-20/09/2024 CV | EUR | 1 355 900 | 0,66 | | | | | |
| 3 700 000 | PHARMING NV 3,000% 20-21/01/2025 CV | EUR | 3 548 300 | 1,72 | | | | | |
| 6 000 000 | SHOP APOTHEKE 0,000% 21-21/01/2028 CV | EUR | 5 585 400 | 2,70 | | | | | |
| 4 000 000 | TAKEAWAY.COM N 2,250% 19-25/01/2024 CV | EUR | 3 979 800 | 1,93 | | | | | |
| 1 690 000 | ZUR ROSE FINANCE 2,750% 20-31/03/2025 CV | CHF | 1 758 949 | 0,85 | | | | | |
| France | | | | | | | | | |
| 1 300 000 | AIR FRANCE-KLM 22-23/02/2171 CV FRN | EUR | 1 487 408 | 0,72 | | | | | |
| 1 074 479 | FIGEAC AERO 1,125% 17-18/10/2028 CV FLAT | EUR | 677 594 | 0,33 | | | | | |
| 70 179 | FNAC DART SA 0,250% 21-23/03/2027 CV FLAT | EUR | 4 899 056 | 2,37 | | | | | |
| 40 000 | GENFIT 3,500% 17-21/10/2025 CV FLAT | EUR | 1 050 920 | 0,51 | | | | | |
| 49 394 | KORIAN SA 21-31/12/2061 CV FRN FLAT | EUR | 1 207 831 | 0,58 | | | | | |
| 62 505 | NEOEN SAS 2,000% 20-02/06/2025 CV FLAT | EUR | 2 848 728 | 1,38 | | | | | |
| 6 800 000 | NEOEN SAS 2,875% 22-14/09/2027 CV | EUR | 6 325 632 | 3,06 | | | | | |
| 109 100 | NEXITY 0,875% 21-19/04/2028 CV FLAT | EUR | 4 305 850 | 2,08 | | | | | |
| 5 400 000 | ORPAR 0,000% 17-20/06/2024 CV | EUR | 5 398 164 | 2,61 | | | | | |
| 15 375 | SOITEC 0,000% 20-01/10/2025 CV | EUR | 2 885 150 | 1,40 | | | | | |
| 297 400 | VOLTALIA SA 1,000% 21-13/01/2025 CV FLAT | EUR | 8 720 659 | 4,22 | | | | | |
| Allemagne | | | | | | | | | |
| 4 000 000 | BECHTLE AG 2,000% 23-08/12/2030 CV | EUR | 4 229 000 | 2,05 | | | | | |
| 5 900 000 | DELIVERY HERO AG 0,250% 20-23/01/2024 CV | EUR | 5 878 164 | 2,85 | | | | | |
| 8 200 000 | DUERR AG 0,750% 20-15/01/2026 CV | EUR | 7 514 480 | 3,64 | | | | | |
| 4 100 000 | HELLOFRESH SE 0,750% 20-13/05/2025 CV | EUR | 3 874 049 | 1,88 | | | | | |
| 3 600 000 | MBT SYSTEMS 3,750% 23-17/05/2029 CV | EUR | 2 427 156 | 1,17 | | | | | |
| 1 000 000 | MORPHOSYS AG 0,625% 20-16/10/2025 CV | EUR | 836 750 | 0,41 | | | | | |
| 1 600 000 | NORDEX SE 4,250% 23-14/04/2030 CV | EUR | 1 583 232 | 0,77 | | | | | |
| 3 900 000 | SGL CARBON SE 5,750% 22-21/09/2027 CV | EUR | 4 002 102 | 1,94 | | | | | |
| 1 600 000 | SGL CARBON SE 5,750% 23-28/06/2028 CV | EUR | 1 606 704 | 0,78 | | | | | |
| Suisse | | | | | | | | | |
| 5 770 000 | BASILEA PHARM 3,250% 20-28/07/2027 CV | CHF | 6 178 375 | 2,99 | | | | | |
| 9 000 000 | CEMBRA MONEY BAN 0,000% 19-09/07/2026 CV | CHF | 9 067 376 | 4,38 | | | | | |
| 1 210 000 | SWISS PRIME SITE 0,325% 18-16/01/2025 CV | CHF | 1 275 673 | 0,62 | | | | | |
| Ile de Jersey | | | | | | | | | |
| 6 300 000 | DERWENT CAP 3 1,500% 19-12/06/2025 CV | GBP | 6 875 437 | 3,33 | | | | | |
| 4 088 000 | PHP FIN JERS 2,875% 19-15/07/2025 CV | GBP | 4 593 345 | 2,22 | | | | | |
| | | | | | Norvège | | | | |
| 600 000 | BORR DRILLING 5,000% 23-08/02/2028 CV | USD | 681 555 | 0,33 | | | | | |
| 10 400 000 | BW OFFSHORE LTD 2,500% 19-12/11/2024 CV | USD | 8 953 423 | 4,32 | | | | | |
| | | | | | Royaume-Uni | | | | |
| 2 900 000 | CAPITAL & COUNTI 2,000% 20-30/03/2026 CV | GBP | 3 079 847 | 1,49 | | | | | |
| 4 700 000 | TRAINLINE PLC 1,000% 21-14/01/2026 CV | GBP | 4 907 244 | 2,38 | | | | | |
| | | | | | Autriche | | | | |
| 1 300 000 | DO & CO AG 1,750% 21-28/01/2026 CV | EUR | 2 134 041 | 1,03 | | | | | |
| 5 800 000 | VOESTALPINE AG 2,750% 23-28/04/2028 CV | EUR | 5 682 260 | 2,75 | | | | | |
| | | | | | Ile Maurice | | | | |
| 8 600 000 | HTA GROUP LTD 2,875% 21-18/03/2027 CV | USD | 6 726 942 | 3,26 | | | | | |
| | | | | | Finlande | | | | |
| 3 800 000 | OUTOKUMPU OYJ 5,000% 20-09/07/2025 CV | EUR | 6 092 578 | 2,95 | | | | | |
| | | | | | Danemark | | | | |
| 6 100 000 | GN STORE NORD 0,000% 19-21/05/2024 CV | EUR | 5 960 737 | 2,89 | | | | | |
| | | | | | Irlande | | | | |
| 5 600 000 | GLANBIA COOP SOC 1,875% 22-27/01/2027 CV | EUR | 5 662 888 | 2,74 | | | | | |
| | | | | | Espagne | | | | |
| 4 300 000 | CRITERIA CAIXA 0,000% 21-22/06/2025 CV | EUR | 4 064 016 | 1,97 | | | | | |
| | | | | | Belgique | | | | |
| 5 300 000 | MITHRA PHARMA 4,250% 20-17/12/2025 CV | EUR | 1 464 655 | 0,71 | | | | | |
| | | | | | Luxembourg | | | | |
| 1 000 000 | GLOBAL FASHION G 1,250% 21-15/03/2028 CV | EUR | 727 740 | 0,35 | | | | | |
| | | | | | Autres valeurs mobilières | | | | |
| | | | | | Obligations convertibles | | | | |
| | | | | | Allemagne | | | | |
| 200 000 | ARCANDOR AG 8,875% 08-31/12/2099 CV DFLT | EUR | 20 | 0,00 | | | | | |
| | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| | | | | | France | | | | |
| 40,91 | BNP PARIBAS CASH INVEST R | EUR | 2 100 411 | 1,02 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | 204 111 716 | 98,81 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Flexible Global Credit

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|---|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 9 634 586 | 64,48 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 300 000 | AMERICAN EXPRESS 3,950% 22-01/08/2025 | USD | 267 326 | 1,79 | | | | | |
| 200 000 | AMGEN INC 2,000% 16-25/02/2026 | EUR | 195 181 | 1,31 | | | | | |
| 200 000 | AT&T INC 0,250% 19-04/03/2026 | EUR | 187 643 | 1,26 | | | | | |
| 300 000 | BANK OF NY MELLO 2,450% 16-17/08/2026 | USD | 256 418 | 1,72 | | | | | |
| 300 000 | CNH INDUSTRIAL 1,450% 21-15/07/2026 | USD | 249 139 | 1,67 | | | | | |
| 200 000 | CVS HEALTH CORP 2,875% 16-01/06/2026 | USD | 173 105 | 1,16 | | | | | |
| 301 000 | DAIMLER FINANCE 3,300% 15-19/05/2025 | USD | 267 025 | 1,79 | | | | | |
| 200 000 | DELL INT / EMC 4,900% 21-01/10/2026 | USD | 181 267 | 1,21 | | | | | |
| 105 000 | DELL INT / EMC 6,020% 21-15/06/2026 | USD | 97 191 | 0,65 | | | | | |
| 300 000 | EBAY INC 1,400% 21-10/05/2026 | USD | 251 272 | 1,68 | | | | | |
| 300 000 | EVERSOURCE ENERG 4,750% 23-15/05/2026 | USD | 268 626 | 1,80 | | | | | |
| 100 000 | GENERAL MOTORS FIN 1,500% 21-10/06/2026 | USD | 82 958 | 0,56 | | | | | |
| 300 000 | GENERAL MOTORS FIN 5,250% 16-01/03/2026 | USD | 271 868 | 1,82 | | | | | |
| 293 000 | GOLDMAN SACHS GROUP 3,750% 16-25/02/2026 | USD | 258 939 | 1,73 | | | | | |
| 200 000 | HYUNDAI CAP AMER 1,300% 21-08/01/2026 | USD | 166 370 | 1,11 | | | | | |
| 200 000 | JOHNSON CONTROLS 3,900% 16-14/02/2026 | USD | 177 196 | 1,19 | | | | | |
| 300 000 | LABORATORY CORP 1,550% 21-01/06/2026 | USD | 250 979 | 1,68 | | | | | |
| 300 000 | MARRIOTT INTERNATIONAL 3,125% 16-15/06/2026 | USD | 260 885 | 1,75 | | | | | |
| 300 000 | PPG INDUSTRIES 0,875% 16-03/11/2025 | EUR | 286 520 | 1,92 | | | | | |
| 200 000 | PPG INDUSTRIES 1,200% 21-15/03/2026 | USD | 167 293 | 1,12 | | | | | |
| 200 000 | STANLEY BLACK 3,400% 19-01/03/2026 | USD | 175 021 | 1,17 | | | | | |
| 200 000 | VOLKSWAGEN GRP 1,250% 20-24/11/2025 | USD | 168 297 | 1,13 | | | | | |
| <i>France</i> | | | 1 439 997 | 9,63 | | | | | |
| 300 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 1,000% 22-23/05/2025 | EUR | 289 823 | 1,94 | | | | | |
| 200 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 5,896% 23-13/07/2026 | USD | 184 486 | 1,23 | | | | | |
| 300 000 | CAPGEMINI SE 0,625% 20-23/06/2025 | EUR | 288 004 | 1,93 | | | | | |
| 200 000 | EDENRED 1,375% 15-10/03/2025 | EUR | 194 895 | 1,30 | | | | | |
| 200 000 | PERNOD RICARD SA 1,125% 20-07/04/2025 | EUR | 194 333 | 1,30 | | | | | |
| 300 000 | VIVENDI SA 0,625% 19-11/06/2025 | EUR | 288 456 | 1,93 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | 1 133 377 | 7,58 | | | | | |
| 200 000 | NATWEST MARKETS 0,125% 21-12/11/2025 | EUR | 188 345 | 1,26 | | | | | |
| 200 000 | SSE PLC 0,875% 17-06/09/2025 | EUR | 191 991 | 1,28 | | | | | |
| 300 000 | TESCO CORP TREAS 0,875% 19-29/05/2026 | EUR | 283 742 | 1,90 | | | | | |
| 200 000 | VODAFONE GROUP 1,875% 14-11/09/2025 | EUR | 194 803 | 1,30 | | | | | |
| 307 000 | VODAFONE GROUP 4,125% 18-30/05/2025 | USD | 274 496 | 1,84 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | 997 888 | 6,67 | | | | | |
| 200 000 | BAYER CAP CORP NV 1,500% 18-26/06/2026 | EUR | 190 379 | 1,27 | | | | | |
| 300 000 | DAIMLER TRUCK 3,875% 23-19/06/2026 | EUR | 304 911 | 2,04 | | | | | |
| 200 000 | FIAT CHRYSLER AU 3,875% 20-05/01/2026 | EUR | 201 596 | 1,35 | | | | | |
| 300 000 | TOYOTA MOTOR FIN 3,375% 23-13/01/2026 | EUR | 301 002 | 2,01 | | | | | |
| | | | | | <i>Canada</i> | | | | |
| 200 000 | BANK NOVA SCOTIA 3,450% 22-11/04/2025 | USD | 177 333 | 1,19 | | | | | |
| 300 000 | MANULIFE FIN COR 4,150% 16-04/03/2026 | USD | 268 047 | 1,79 | | | | | |
| 200 000 | ROYAL BANK OF CANADA 1,150% 20-10/06/2025 | USD | 171 632 | 1,15 | | | | | |
| | | | | | <i>Espagne</i> | | | | |
| 300 000 | ARVAL SERVICE 3,375% 22-04/01/2026 | EUR | 299 464 | 2,00 | | | | | |
| 300 000 | BANCO SANTANDER 1,375% 20-05/01/2026 | EUR | 287 640 | 1,92 | | | | | |
| | | | | | <i>Norvège</i> | | | | |
| 200 000 | SPAREBANK 1 SMN 3,125% 22-22/12/2025 | EUR | 198 689 | 1,33 | | | | | |
| | | | | | Obligations à taux flottant | | | | |
| | | | | | 2 878 861 | | | | |
| | | | | | 19,27 | | | | |
| | | | | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 279 000 | BANK OF AMERICA CORP 18-23/01/2026 FRN | USD | 246 709 | 1,65 | | | | | |
| 200 000 | CITIGROUP INC 19-24/04/2025 FRN | USD | 179 750 | 1,20 | | | | | |
| 300 000 | CITIGROUP INC 20-06/07/2026 FRN | EUR | 288 729 | 1,93 | | | | | |
| 300 000 | JPMORGAN CHASE 19-11/03/2027 FRN | EUR | 284 904 | 1,91 | | | | | |
| 200 000 | MORGAN STANLEY 20-10/12/2026 FRN | USD | 166 667 | 1,12 | | | | | |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| | | | | | 764 902 | | | | |
| | | | | | 5,12 | | | | |
| 200 000 | CREDIT AGRICOLE SA 20-22/04/2026 FRN | EUR | 192 874 | 1,29 | | | | | |
| 200 000 | CREDIT AGRICOLE SA 22-22/04/2027 FRN | EUR | 192 763 | 1,29 | | | | | |
| 200 000 | LA BANQUE POSTALE 20-17/06/2026 FRN | EUR | 190 962 | 1,28 | | | | | |
| 200 000 | SOCIETE GENERALE 21-17/11/2026 FRN | EUR | 188 303 | 1,26 | | | | | |
| | | | | | <i>Japon</i> | | | | |
| | | | | | 288 328 | | | | |
| | | | | | 1,93 | | | | |
| 333 000 | MIZUHO FINANCIAL 20-25/05/2026 FRN | USD | 288 328 | 1,93 | | | | | |
| | | | | | <i>Royaume-Uni</i> | | | | |
| | | | | | 274 459 | | | | |
| | | | | | 1,84 | | | | |
| 314 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 20-05/02/2026 FRN | USD | 274 459 | 1,84 | | | | | |
| | | | | | <i>Belgique</i> | | | | |
| | | | | | 194 256 | | | | |
| | | | | | 1,30 | | | | |
| 200 000 | KBC GROUP NV 22-29/03/2026 FRN | EUR | 194 256 | 1,30 | | | | | |
| | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| | | | | | 190 157 | | | | |
| | | | | | 1,27 | | | | |
| 200 000 | ING GROEP NV 22-16/02/2027 FRN | EUR | 190 157 | 1,27 | | | | | |
| | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| | | | | | 1 453 682 | | | | |
| | | | | | 9,72 | | | | |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| | | | | | 1 453 682 | | | | |
| | | | | | 9,72 | | | | |
| 11,57 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 272 424 | 1,82 | | | | | |
| 14,51 | BNP PARIBAS MULTI-FACTOR BONDS HIGH VOL - R PLUS CAP | EUR | 1 181 258 | 7,90 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 13 967 129 | | | | |
| | | | | | 93,47 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global Absolute Return Multi-Factor Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | 4 634 827 | 81,44 |
| | Obligations | | 4 634 827 | 81,44 |
| | <i>France</i> | | <i>1 096 049</i> | <i>19,25</i> |
| 200 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,125% 19-05/02/2024 | EUR | 199 267 | 3,50 |
| 200 000 | LA BANQUE POSTALE 1,000% 17-16/10/2024 | EUR | 195 565 | 3,44 |
| 200 000 | SOCIETE GENERALE 1,250% 19-15/02/2024 | EUR | 199 304 | 3,50 |
| 500 000 | VEOLIA ENVRNMT 0,892% 19-14/01/2024 | EUR | 501 913 | 8,81 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>593 220</i> | <i>10,43</i> |
| 200 000 | EMERSON ELECTRIC 0,375% 19-22/05/2024 | EUR | 197 252 | 3,47 |
| 200 000 | GOLDMAN SACHS GROUP 1,375% 17-15/05/2024 | EUR | 198 054 | 3,48 |
| 200 000 | KRAFT HEINZ FOOD 1,500% 16-24/05/2024 | EUR | 197 914 | 3,48 |
| | <i>Japon</i> | | <i>491 206</i> | <i>8,63</i> |
| 300 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCE 0,872% 17-07/09/2024 | EUR | 293 852 | 5,16 |
| 200 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCE 0,978% 20-09/06/2024 | EUR | 197 354 | 3,47 |
| | <i>Espagne</i> | | <i>491 054</i> | <i>8,63</i> |
| 500 000 | SANTANDER CONSUMER FIN 0,375% 19-27/06/2024 | EUR | 491 054 | 8,63 |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>394 922</i> | <i>6,94</i> |
| 200 000 | MONDI FINANCE PL 1,500% 16-15/04/2024 | EUR | 198 458 | 3,49 |
| 200 000 | WESTPAC SEC NZ 0,300% 19-25/06/2024 | EUR | 196 464 | 3,45 |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>377 986</i> | <i>6,64</i> |
| 180 000 | ABN AMRO BANK NV 0,875% 19-15/01/2024 | EUR | 179 723 | 3,16 |
| 200 000 | RELX FINANCE 0,000% 20-18/03/2024 | EUR | 198 263 | 3,48 |
| | <i>Italie</i> | | <i>201 201</i> | <i>3,54</i> |
| 200 000 | ASSICURAZIONI GENERALI 5,125% 09-16/09/2024 | EUR | 201 201 | 3,54 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>199 615</i> | <i>3,51</i> |
| 200 000 | KBC GROUP NV 1,125% 19-25/01/2024 | EUR | 199 615 | 3,51 |
| | <i>Mexique</i> | | <i>198 902</i> | <i>3,49</i> |
| 200 000 | AMERICA MOVIL SA 1,500% 16-10/03/2024 | EUR | 198 902 | 3,49 |
| | <i>Australie</i> | | <i>198 438</i> | <i>3,49</i> |
| 200 000 | BRAMBLES FINANCE 2,375% 14-12/06/2024 | EUR | 198 438 | 3,49 |
| | <i>Canada</i> | | <i>197 546</i> | <i>3,47</i> |
| 200 000 | CAN IMPERIAL BK 0,375% 19-03/05/2024 | EUR | 197 546 | 3,47 |
| | <i>Suède</i> | | <i>194 688</i> | <i>3,42</i> |
| 200 000 | VOLVO TREAS AB 0,125% 20-17/09/2024 | EUR | 194 688 | 3,42 |
| | Instruments du marché monétaire | | 199 134 | 3,50 |
| | <i>France</i> | | <i>199 134</i> | <i>3,50</i> |
| 200 000 | FRENCH BTF 0,000% 23-14/02/2024 | EUR | 199 134 | 3,50 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 561 138 | 9,85 |
| | <i>France</i> | | <i>561 138</i> | <i>9,85</i> |
| 23,84 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 561 138 | 9,85 |
| | Total portefeuille-titres | | 5 395 099 | 94,79 |

BNP PARIBAS FUNDS Global Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|---------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Autriche</i> | | <i>1 306 547</i> | <i>0,36</i> | | <i>Israël</i> | | <i>849 975</i> | <i>0,24</i> |
| 50 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 0,500% 19-20/02/2029 | EUR | 45 533 | 0,01 | 450 000 | ISRAEL FIXED 0,400% 21-31/10/2024 FLAT | ILS | 109 373 | 0,03 |
| 80 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 2,100% 17-20/09/2117 | EUR | 62 261 | 0,02 | 267 000 | ISRAEL FIXED 1,000% 19-31/03/2030 FLAT | ILS | 57 179 | 0,02 |
| 500 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 2,900% 23-20/02/2033 | EUR | 511 743 | 0,14 | 108 000 | ISRAEL FIXED 1,500% 20-31/05/2037 FLAT | ILS | 19 644 | 0,01 |
| 600 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 4,150% 07-15/03/2037 | EUR | 687 010 | 0,19 | 368 000 | ISRAEL FIXED 2,000% 16-31/03/2027 FLAT | ILS | 89 235 | 0,02 |
| | <i>Thaïlande</i> | | <i>1 035 127</i> | <i>0,30</i> | 400 000 | ISRAEL FIXED 3,750% 17-31/03/2047 FLAT | ILS | 92 092 | 0,03 |
| 3 320 000 | THAILAND GOVERNMENT 0,950% 20-17/06/2025 | THB | 86 116 | 0,02 | 100 000 | STATE OF ISRAEL 1,500% 19-16/01/2029 | EUR | 88 707 | 0,02 |
| 5 790 000 | THAILAND GOVERNMENT 1,000% 21-17/06/2027 | THB | 146 081 | 0,04 | 500 000 | STATE OF ISRAEL 2,500% 20-15/01/2030 | USD | 393 745 | 0,11 |
| 5 480 000 | THAILAND GOVERNMENT 1,585% 20-17/12/2035 | THB | 128 278 | 0,04 | | <i>Singapour</i> | | <i>820 267</i> | <i>0,24</i> |
| 4 020 000 | THAILAND GOVERNMENT 2,875% 16-17/06/2046 | THB | 97 262 | 0,03 | 100 000 | PFIZER INVSTMNT 5,340% 23-19/05/2063 | USD | 91 534 | 0,03 |
| 4 705 000 | THAILAND GOVERNMENT 2,875% 18-17/12/2028 | THB | 127 146 | 0,04 | 100 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 1,625% 21-01/07/2031 | SGD | 63 504 | 0,02 |
| 1 850 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,300% 18-17/06/2038 | THB | 50 585 | 0,01 | 190 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 2,125% 16-01/06/2026 | SGD | 127 461 | 0,04 |
| 1 500 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,600% 17-17/06/2067 | THB | 38 319 | 0,01 | 70 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 2,250% 16-01/08/2036 | SGD | 45 537 | 0,01 |
| 4 835 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,775% 12-25/06/2032 | THB | 139 130 | 0,04 | 34 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 2,625% 22-01/08/2032 | SGD | 23 158 | 0,01 |
| 3 600 000 | THAILAND GOVERNMENT 3,850% 10-12/12/2025 | THB | 98 105 | 0,03 | 120 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 2,750% 12-01/04/2042 | SGD | 82 143 | 0,02 |
| 3 500 000 | THAILAND GOVERNMENT 4,000% 15-17/06/2066 | THB | 96 185 | 0,03 | 30 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 2,750% 13-01/09/2033 | SGD | 21 744 | 0,01 |
| 940 000 | THAILAND GOVERNMENT 4,875% 09-22/06/2029 | THB | 27 920 | 0,01 | 170 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 2,750% 16-01/03/2046 | SGD | 116 100 | 0,03 |
| | <i>Chili</i> | | <i>1 000 190</i> | <i>0,26</i> | 165 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 2,875% 10-01/09/2030 | SGD | 114 143 | 0,03 |
| 200 000 | CHILE 3,250% 21-21/09/2071 | USD | 121 023 | 0,03 | 193 000 | SINGAPORE GOVERNMENT 3,500% 07-01/03/2027 | SGD | 134 943 | 0,04 |
| 250 000 | CHILE 4,000% 22-31/01/2052 | USD | 185 791 | 0,05 | | <i>Suisse</i> | | <i>627 283</i> | <i>0,17</i> |
| 300 000 | CODELCO INC 3,625% 17-01/08/2027 | USD | 257 152 | 0,07 | 510 000 | SWISS (GOVERNMENT) 1,500% 12-30/04/2042 | CHF | 627 283 | 0,17 |
| 300 000 | EMPRESA NACIONAL 5,250% 18-06/11/2029 | USD | 262 308 | 0,07 | | <i>Portugal</i> | | <i>623 508</i> | <i>0,17</i> |
| 40 000 000 | TESORERIA PESOS 4,500% 15-01/03/2026 FLAT | CLP | 41 319 | 0,01 | 550 000 | PORTUGUESE OTS 0,475% 20-18/10/2030 | EUR | 484 072 | 0,13 |
| 30 000 000 | TESORERIA PESOS 4,700% 18-01/09/2030 FLAT | CLP | 30 398 | 0,01 | 90 000 | PORTUGUESE OTS 0,900% 20-12/10/2035 | EUR | 72 346 | 0,02 |
| 10 000 000 | TESORERIA PESOS 5,100% 19-15/07/2050 FLAT | CLP | 10 314 | 0,00 | 60 000 | PORTUGUESE OTS 4,100% 06-15/04/2037 | EUR | 67 090 | 0,02 |
| 15 000 000 | TESORERIA PESOS 5,300% 23-01/11/2037 FLAT | CLP | 15 464 | 0,00 | | <i>Finlande</i> | | <i>555 095</i> | <i>0,15</i> |
| 50 000 000 | TESORERIA PESOS 5,800% 23-01/10/2034 FLAT | CLP | 53 969 | 0,01 | 640 000 | FINNISH GOVERNMENT 1,125% 18-15/04/2034 | EUR | 555 095 | 0,15 |
| 20 000 000 | TESORERIA PESOS 6,000% 13-01/01/2043 | CLP | 22 452 | 0,01 | | <i>Ile de Jersey</i> | | <i>505 702</i> | <i>0,14</i> |
| | <i>Pologne</i> | | <i>957 820</i> | <i>0,27</i> | 500 000 | GATWICK FND LTD 2,500% 21-15/04/2030 | GBP | 505 702 | 0,14 |
| 310 000 | POLAND GOVERNMENT BOND 1,750% 21-25/04/2032 | PLN | 55 514 | 0,02 | | <i>Supranational</i> | | <i>502 981</i> | <i>0,14</i> |
| 1 445 000 | POLAND GOVERNMENT BOND 2,500% 15-25/07/2026 | PLN | 313 334 | 0,09 | 3 000 000 000 | EURO BK RECON&DV 4,250% 21-07/02/2028 | IDR | 165 020 | 0,05 |
| 430 000 | POLAND GOVERNMENT BOND 3,250% 14-25/07/2025 | PLN | 96 386 | 0,03 | 5 800 000 000 | EURO BK RECON&DV 6,000% 23-17/01/2030 | IDR | 337 961 | 0,09 |
| 30 000 | POLAND GOVERNMENT BOND 4,000% 17-25/04/2047 | PLN | 5 760 | 0,00 | | <i>Hongrie</i> | | <i>496 256</i> | <i>0,13</i> |
| 50 000 | REPUBLIC OF POLAND 1,000% 19-07/03/2029 | EUR | 45 979 | 0,01 | 7 220 000 | HUNGARY GOVERNMENT 3,000% 18-27/10/2038 | HUF | 13 188 | 0,00 |
| 50 000 | REPUBLIC OF POLAND 3,375% 12-09/07/2024 | EUR | 49 752 | 0,01 | 22 580 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 2,250% 20-20/04/2033 | HUF | 44 654 | 0,01 |
| 250 000 | REPUBLIC OF POLAND 5,500% 22-16/11/2027 | USD | 234 749 | 0,07 | 9 700 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,000% 16-27/10/2027 | HUF | 23 084 | 0,01 |
| 166 000 | REPUBLIC OF POLAND 5,500% 23-04/04/2053 | USD | 156 346 | 0,04 | 18 830 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,000% 19-21/08/2030 | HUF | 42 139 | 0,01 |
| | <i>Arabie saoudite</i> | | <i>926 439</i> | <i>0,26</i> | 3 530 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,000% 20-25/04/2041 | HUF | 6 217 | 0,00 |
| 300 000 | SAUDI ARAB OIL 2,250% 20-24/11/2030 | USD | 232 285 | 0,06 | 600 000 | REPUBLIC OF HUNGARY 3,125% 21-21/09/2051 | USD | 366 974 | 0,10 |
| 210 000 | SAUDI INT BOND 4,625% 17-04/10/2047 | USD | 169 950 | 0,05 | | <i>Cameroun</i> | | <i>495 914</i> | <i>0,14</i> |
| 200 000 | SAUDI INT BOND 5,000% 23-18/01/2053 | USD | 170 133 | 0,05 | 675 000 | REPUBLIC OF CAMEROON 5,950% 21-07/07/2032 | EUR | 495 914 | 0,14 |
| 400 000 | SAUDI INT BOND 5,250% 19-16/01/2050 | USD | 354 071 | 0,10 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>République tchèque</i> | | <i>493 354</i> | <i>0,12</i> | | Obligations à taux flottant | | 31 371 560 | 8,75 |
| 1 400 000 | CZECH REPUBLIC 0,950% 15-15/05/2030 | CZK | 47 842 | 0,01 | | <i>Espagne</i> | | <i>11 927 376</i> | <i>3,31</i> |
| 3 730 000 | CZECH REPUBLIC 1,000% 15-26/06/2026 | CZK | 139 955 | 0,04 | 200 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 23-13/01/2031 FRN | EUR | 209 803 | 0,06 |
| 1 130 000 | CZECH REPUBLIC 1,200% 20-13/03/2031 | CZK | 38 464 | 0,01 | 100 000 | BANCO SABADELL 23-07/06/2029 FRN | EUR | 105 014 | 0,03 |
| 1 520 000 | CZECH REPUBLIC 2,000% 17-13/10/2033 | CZK | 52 679 | 0,01 | 100 000 | BANCO SABADELL 23-08/09/2029 FRN | EUR | 103 929 | 0,03 |
| 3 880 000 | CZECH REPUBLIC 2,750% 18-23/07/2029 | CZK | 149 055 | 0,04 | 100 000 | BANCO SABADELL 23-16/08/2033 FRN | EUR | 101 109 | 0,03 |
| 1 200 000 | CZECH REPUBLIC 4,200% 06-04/12/2036 | CZK | 50 384 | 0,01 | 3 800 000 | BANCO SANTANDER 19-31/12/2049 FRN | USD | 3 437 079 | 0,95 |
| 330 000 | CZECH REPUBLIC 4,850% 07-26/11/2057 | CZK | 14 975 | 0,00 | 200 000 | BANCO SANTANDER 23-21/02/2172 FRN | USD | 193 448 | 0,05 |
| | <i>Iles Vierges britanniques</i> | | <i>492 916</i> | <i>0,14</i> | 100 000 | BANCO SANTANDER 23-23/08/2033 FRN | EUR | 104 745 | 0,03 |
| 600 000 | HUARONG FINANCE 4,250% 17-07/11/2027 | USD | 492 916 | 0,14 | 3 600 000 | CAIXABANK 17-31/12/2049 FRN | EUR | 3 591 221 | 1,00 |
| | <i>Philippines</i> | | <i>475 499</i> | <i>0,13</i> | 4 000 000 | CAIXABANK 20-31/12/2060 FRN | EUR | 3 869 722 | 1,07 |
| 220 000 | ASIAN DEV BANK 1,400% 17-06/02/2037 | EUR | 185 843 | 0,05 | 200 000 | CAIXABANK 23-30/05/2034 FRN | EUR | 211 306 | 0,06 |
| 300 000 | PHILIPPINES GOVERNMENT 5,609% 22-13/04/2033 | USD | 289 656 | 0,08 | | <i>Belgique</i> | | <i>6 006 769</i> | <i>1,67</i> |
| | <i>Suède</i> | | <i>460 023</i> | <i>0,13</i> | 7 000 000 | BELFIUS BANK SA 18-31/12/2049 FRN | EUR | 6 006 769 | 1,67 |
| 5 020 000 | SWEDISH GOVERNMENT 2,250% 12-01/06/2032 | SEK | 460 023 | 0,13 | | <i>Italie</i> | | <i>3 450 939</i> | <i>0,96</i> |
| | <i>Irlande</i> | | <i>381 736</i> | <i>0,10</i> | 3 420 000 | INTESA SANPAOLO 20-01/03/2169 FRN | EUR | 3 080 866 | 0,86 |
| 150 000 | AERCAP IRELAND 3,000% 21-29/10/2028 | USD | 123 952 | 0,03 | 400 000 | INTESA SANPAOLO 20-01/03/2169 FRN | EUR | 370 073 | 0,10 |
| 100 000 | IRISH GOVERNMENT 2,400% 14-15/05/2030 | EUR | 101 113 | 0,03 | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>3 225 073</i> | <i>0,90</i> |
| 167 000 | TRANE TECH 5,250% 23-03/03/2033 | USD | 156 671 | 0,04 | 100 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 90 875 | 0,03 |
| | <i>Uruguay</i> | | <i>376 045</i> | <i>0,10</i> | 4 000 000 | ING GROEP NV 21-31/12/2061 FRN | USD | 2 924 622 | 0,81 |
| 83 078 | URUGUAY 4,375% 19-23/01/2031 | USD | 74 479 | 0,02 | 100 000 | ING GROEP NV 23/05/2029 FRN | EUR | 103 004 | 0,03 |
| 307 737 | URUGUAY 5,750% 22-28/10/2034 | USD | 301 566 | 0,08 | 100 000 | TELEFONICA EUROPE 23-07/09/2172 FRN | EUR | 106 572 | 0,03 |
| | <i>Qatar</i> | | <i>365 980</i> | <i>0,10</i> | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>3 131 707</i> | <i>0,87</i> |
| 400 000 | STATE OF QATAR 5,103% 18-23/04/2048 | USD | 365 980 | 0,10 | 100 000 | AMERICAN EXPRESS 23-01/05/2034 FRN | USD | 90 362 | 0,03 |
| | <i>Iles Caïmans</i> | | <i>332 053</i> | <i>0,10</i> | 450 000 | BANK OF AMERICA CORP 21-21/07/2032 FRN | USD | 331 872 | 0,09 |
| 200 000 | DP WORLD CRESCEN 3,750% 19-30/01/2030 | USD | 169 954 | 0,05 | 177 000 | BANK OF AMERICA CORP 23-25/04/2029 FRN | USD | 161 251 | 0,04 |
| 200 000 | SHARIAH SUKUK 3,234% 19-23/10/2029 | USD | 162 099 | 0,05 | 200 000 | BANK OF NY MELLO 23-25/10/2029 FRN | USD | 192 080 | 0,05 |
| | <i>Australie</i> | | <i>251 598</i> | <i>0,08</i> | 100 000 | CAPITAL ONE FINL 23-29/10/2027 FRN | USD | 94 002 | 0,03 |
| 150 000 | AUSTRALIAN GOVERNMENT 1,750% 20-21/06/2051 | AUD | 54 697 | 0,02 | 100 000 | CHARLES SCHWAB 23-19/05/2029 FRN | USD | 92 906 | 0,03 |
| 140 000 | AUSTRALIAN GOVERNMENT 3,000% 16-21/03/2047 | AUD | 69 822 | 0,02 | 33 000 | CHARLES SCHWAB 23-24/08/2034 FRN | USD | 31 431 | 0,01 |
| 230 000 | AUSTRALIAN GOVERNMENT 3,250% 15-21/06/2039 | AUD | 127 079 | 0,04 | 250 000 | CITIGROUP INC 19-05/11/2030 FRN | USD | 201 641 | 0,06 |
| | <i>Venezuela</i> | | <i>193 975</i> | <i>0,05</i> | 100 000 | FIFTH THIRD BANC 23-27/07/2029 FRN | USD | 94 074 | 0,03 |
| 200 000 | CORP ANDINA FOM 1,125% 18-13/02/2025 | EUR | 193 975 | 0,05 | 450 000 | GOLDMAN SACHS GROUP 18-01/05/2029 FRN | USD | 393 987 | 0,11 |
| | <i>Malaisie</i> | | <i>130 068</i> | <i>0,04</i> | 100 000 | JPMORGAN CHASE 22-26/04/2033 FRN | USD | 87 478 | 0,02 |
| 134 000 | PETRONAS 7,625% 96 -15/10/2026 | USD | 130 068 | 0,04 | 250 000 | JPMORGAN CHASE 23-01/06/2034 FRN | USD | 229 638 | 0,06 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>121 210</i> | <i>0,03</i> | 200 000 | MORGAN STANLEY 20-22/01/2031 FRN | USD | 158 245 | 0,04 |
| 114 000 | CARLSBERG BREW 4,250% 23-05/10/2033 | EUR | 121 210 | 0,03 | 100 000 | MORGAN STANLEY 23-01/11/2029 FRN | USD | 95 941 | 0,03 |
| | <i>Norvège</i> | | <i>105 241</i> | <i>0,03</i> | 200 000 | MORGAN STANLEY 23-20/07/2029 FRN | USD | 184 488 | 0,05 |
| 100 000 | SPAREBANK 1 SR 4,875% 23-24/08/2028 | EUR | 105 241 | 0,03 | 100 000 | PNC FINANCIAL 23-18/08/2034 FRN | USD | 94 153 | 0,03 |
| | <i>Panama</i> | | <i>81 949</i> | <i>0,02</i> | 125 000 | STATE STREET CRP 23-21/11/2034 FRN | USD | 120 149 | 0,03 |
| 80 000 | PANAMA 9,375% 99-01/04/2029 | USD | 81 949 | 0,02 | 200 000 | TRUIST FINANCIAL 23-30/10/2029 FRN | USD | 195 504 | 0,05 |
| | <i>Russie</i> | | <i>8 814</i> | <i>0,00</i> | 100 000 | WELLS FARGO CO 23-23/10/2034 FRN | USD | 98 309 | 0,03 |
| 2 560 000 | RUSSIA-OFZ 6,900% 18-23/05/2029 | RUB | 8 814 | 0,00 | 200 000 | WELLS FARGO CO 23-25/07/2034 FRN | USD | 184 196 | 0,05 |
| | | | | | | <i>France</i> | | <i>1 091 762</i> | <i>0,31</i> |
| | | | | | 100 000 | ACCOR 23-11/04/2172 FRN | EUR | 108 482 | 0,03 |
| | | | | | 100 000 | BNP PARIBAS 23-05/12/2034 FRN | USD | 94 550 | 0,03 |
| | | | | | 100 000 | BNP PARIBAS 23-14/02/2172 FRN | USD | 95 043 | 0,03 |
| | | | | | 200 000 | BNP PARIBAS 23-26/09/2032 FRN | EUR | 209 321 | 0,06 |
| | | | | | 250 000 | BPCE 23-19/10/2027 FRN | USD | 233 149 | 0,06 |

BNP PARIBAS FUNDS Global Bond Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| 150 000 | CRÉDIT AGRICOLE SA 23-03/10/2029 FRN | USD | 142 351 | 0,04 | 443 374 | STACR 2023-DNA2 M1A 23-25/04/2043 FRN | USD | 407 632 | 0,11 |
| 100 000 | FRANCE TELECOM 02-01/03/2031 SR FRN | USD | 111 916 | 0,03 | 1 085 082 | STACR 2023-HQA2 M1A 23-25/06/2043 FRN | USD | 990 763 | 0,28 |
| 100 000 | SOCIETE GENERALE 23-14/05/2172 FRN | USD | 96 950 | 0,03 | 290 040 | STACR 2023-HQA3 M1 23-25/11/2043 FRN | USD | 264 141 | 0,07 |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>690 667</i> | <i>0,20</i> | | To be Announced (« TBA ») | | 11 272 255 | 3,12 |
| 100 000 | BARCLAYS PLC 23-09/05/2027 FRN | USD | 91 357 | 0,03 | | Mortgage Backed Securified | | | |
| 100 000 | BARCLAYS PLC 23-27/06/2034 FRN | USD | 96 272 | 0,03 | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>11 272 255</i> | <i>3,12</i> |
| 100 000 | HSBC HOLDINGS 23-13/11/2034 FRN | USD | 99 287 | 0,03 | (100 000) | FNCI 2 1/21 2,000% 21-31/12/2060 | USD | (81 148) | (0,02) |
| 100 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 23-21/09/2031 FRN | EUR | 105 600 | 0,03 | (100 000) | FNCI 2,5 1/13 2,500% 13-25/11/2027 | USD | (83 390) | (0,02) |
| 200 000 | STANDARD CHART 23-08/02/2030 FRN | USD | 191 304 | 0,05 | 400 000 | FNCI 3 1/15 3,000% 15-25/06/2029 | USD | 341 384 | 0,09 |
| 100 000 | VODAFONE GROUP 23-30/08/2084 FRN | EUR | 106 847 | 0,03 | 300 000 | FNCI 4 1/13 4,000% 13-25/02/2025 | USD | 266 445 | 0,07 |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>471 150</i> | <i>0,14</i> | 100 000 | FNCL 4,5 1/11 4,500% 11-25/03/2024 | USD | 90 074 | 0,03 |
| 200 000 | COMMERZBANK AG 23-05/10/2033 FRN | EUR | 213 031 | 0,06 | 700 000 | FNCL 2,5 1/15 2,500% 15-25/03/2044 | USD | 539 028 | 0,15 |
| 200 000 | DEUTSCHE BANK AG 21-17/02/2032 FRN | EUR | 164 175 | 0,05 | 500 000 | FNCL 3 1/13 3,000% 13-25/10/2042 | USD | 400 350 | 0,11 |
| 100 000 | DEUTSCHE BANK AG 22-23/02/2028 FRN | EUR | 93 944 | 0,03 | (100 000) | FNCL 3,5 1/12 3,500% 12-25/06/2041 | USD | (83 044) | (0,02) |
| | <i>Irlande</i> | | <i>412 609</i> | <i>0,12</i> | 600 000 | FNCL 4,000% 10-25/09/2039 | USD | 513 688 | 0,14 |
| 100 000 | AIB GROUP PLC 23-13/09/2029 FRN | USD | 95 377 | 0,03 | 900 000 | FNCL 5 1/11 5,000% 11-25/08/2037 | USD | 806 017 | 0,22 |
| 200 000 | BANK OF IRELAND 23-04/07/2031 FRN | EUR | 213 370 | 0,06 | 2 000 000 | FNCL 5,5 1/13 5,500% 13-25/06/2038 | USD | 1 818 166 | 0,51 |
| 100 000 | BANK OF IRELAND 23-13/11/2029 FRN | EUR | 103 862 | 0,03 | 1 100 000 | FNCL 6 1/11 6,000% 11-25/09/2038 | USD | 1 011 039 | 0,28 |
| | <i>Suisse</i> | | <i>286 583</i> | <i>0,08</i> | 100 000 | FNCL 7 1/24 7,000% 24-31/12/2063 | USD | 93 373 | 0,03 |
| 100 000 | CREDIT SUISSE 22-15/11/2033 FRN | USD | 110 951 | 0,03 | 300 000 | G2SF 2 1/21 2,000% 21-31/12/2060 | USD | 229 919 | 0,06 |
| 200 000 | UBS GROUP 20-05/11/2028 FRN | EUR | 175 632 | 0,05 | 1 600 000 | G2SF 2,5 1/20 2,500% 20-31/12/2059 | USD | 1 266 921 | 0,35 |
| | <i>Australie</i> | | <i>198 121</i> | <i>0,05</i> | 400 000 | G2SF 3 1/13 3,000% 13-20/05/2042 | USD | 327 818 | 0,09 |
| 200 000 | MACQUARIE GROUP 21-21/08/2029 FRN | CAD | 123 383 | 0,03 | 200 000 | G2SF 3,5 1/12 3,500% 12-20/09/2041 | USD | 168 605 | 0,05 |
| 79 000 | MACQUARIE GROUP 23-07/12/2034 FRN | USD | 74 738 | 0,02 | 200 000 | G2SF 4 1/11 4,000% 11-20/09/2040 | USD | 172 849 | 0,05 |
| | <i>Singapour</i> | | <i>165 006</i> | <i>0,05</i> | 500 000 | G2SF 5 1/11 5,000% 11-20/05/2040 | USD | 449 450 | 0,12 |
| 200 000 | UNITED OVERSEAS 21-14/10/2031 FRN | USD | 165 006 | 0,05 | 1 900 000 | G2SF 5,5 1/23 5,500% 23-31/12/2062 | USD | 1 732 369 | 0,48 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>105 349</i> | <i>0,03</i> | 800 000 | G2SF 6 1/23 6,000% 23-31/12/2062 | USD | 736 347 | 0,20 |
| 100 000 | DANSKE BANK A/S 23-21/06/2030 FRN | EUR | 105 349 | 0,03 | 600 000 | G2SF 6,5 1/24 6,500% 24-31/12/2063 | USD | 555 995 | 0,15 |
| | <i>Grèce</i> | | <i>104 833</i> | <i>0,03</i> | | Autres valeurs mobilières | | 218 101 | 0,06 |
| 100 000 | PIRAEUS BANK 23-05/12/2029 FRN | EUR | 104 833 | 0,03 | | Obligations | | 218 101 | 0,06 |
| | <i>Portugal</i> | | <i>103 616</i> | <i>0,03</i> | | <i>Chine</i> | | <i>218 101</i> | <i>0,06</i> |
| 100 000 | EDP SA 23/04/2083 FRN | EUR | 103 616 | 0,03 | 4 190 000 | CHINA SCE GRP 7,000% 20-02/05/2025 DFLT | USD | 218 101 | 0,06 |
| | Obligations à taux flottants | | 9 669 299 | 2,69 | | Instruments du marché monétaire | | 193 948 | 0,05 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>9 669 299</i> | <i>2,69</i> | | <i>France</i> | | <i>193 948</i> | <i>0,05</i> |
| 277 581 | CAS 2022-R06 1M1 22-25/05/2042 FRN | USD | 258 337 | 0,07 | 200 000 | UNEDIC 0,125% 17-25/11/2024 NEUMTN | EUR | 193 948 | 0,05 |
| 500 000 | CAS 2023-R04 1M2 23-25/05/2043 FRN | USD | 481 501 | 0,13 | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 34 474 758 | 9,57 |
| 1 086 416 | CAS 2023-R07 2M1 23-25/09/2043 FRN | USD | 992 679 | 0,28 | | <i>Luxembourg</i> | | <i>26 185 433</i> | <i>7,27</i> |
| 1 179 512 | FHR 4993 LS 20-25/07/2050 FRN | USD | 151 997 | 0,04 | 19 879,64 | BNP PARIBAS FUNDS RMB BOND - X CAP | USD | 22 307 708 | 6,19 |
| 346 416 | FSPC T-62 1A1 04-25/10/2044 FRN | USD | 284 753 | 0,08 | 41,11 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ASIAN CITIES BOND - X CAP | USD | 3 877 725 | 1,08 |
| 1 785 856 | GNR 2011-123 SD 11-20/09/2041 FRN | USD | 210 927 | 0,06 | | <i>France</i> | | <i>8 289 325</i> | <i>2,30</i> |
| 4 516 186 | GNR 2022-103 KS 22-20/06/2052 FRN | USD | 372 939 | 0,10 | 808,03 | BNP PARIBAS INVEST 3 MOIS - X | EUR | 8 289 325 | 2,30 |
| 2 410 440 | GNR 2022-159 SM 22-20/09/2052 FRN | USD | 202 934 | 0,06 | | Total portefeuille-titres | | 331 511 753 | 92,08 |
| 3 013 698 | GNR 2022-171 AS 22-20/07/2052 FRN | USD | 287 333 | 0,08 | | | | | |
| 400 000 | JPMMT 2023-HE3 A1 23-25/05/2054 FRN | USD | 362 106 | 0,10 | | | | | |
| 155 146 | STACR 2020-DNA5 M2 20-25/10/2050 FRN | USD | 142 420 | 0,04 | | | | | |
| 1 390 281 | STACR 2020-DNA6 M2 20-25/12/2050 FRN | USD | 1 268 326 | 0,35 | | | | | |
| 200 000 | STACR 2020-HQA2 B1 20-25/03/2050 FRN | USD | 198 161 | 0,06 | | | | | |
| 800 000 | STACR 2021-DNA7 M2 21-25/11/2041 FRN | USD | 715 122 | 0,20 | | | | | |
| 962 568 | STACR 2021-HQA4 M1 21-25/12/2041 FRN | USD | 860 513 | 0,24 | | | | | |
| 1 300 000 | STACR 2022-HQA3 M1B 22-25/08/2042 FRN | USD | 1 216 715 | 0,34 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global Climate Solutions

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|--------------------|-------------------------------|----------------------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 136 042 572 | 98,44 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 37 405 | AECOM | USD | 3 129 810 | 2,26 | | | | | |
| 16 017 | ALBEMARLE CORP | USD | 2 094 904 | 1,52 | | | | | |
| 52 084 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 6 223 299 | 4,51 | | | | | |
| 192 128 | ARRAY TECHNOLOGIES INC | USD | 2 921 967 | 2,11 | | | | | |
| 28 152 | BALL CORP | USD | 1 465 897 | 1,06 | | | | | |
| 135 337 | DARLING INGREDIENTS INC | USD | 6 106 184 | 4,43 | | | | | |
| 4 671 | DEERE & CO | USD | 1 690 846 | 1,22 | | | | | |
| 9 480 | ECOLAB INC | USD | 1 702 221 | 1,23 | | | | | |
| 69 156 | FLUENCE ENERGY INC | USD | 1 493 116 | 1,08 | | | | | |
| 128 150 | FORD MOTOR CO | USD | 1 414 157 | 1,02 | | | | | |
| 129 502 | GREEN PLAINS INC | USD | 2 956 629 | 2,14 | | | | | |
| 61 936 | MUELLER INDUSTRIES INC | USD | 2 643 627 | 1,91 | | | | | |
| 97 795 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 5 377 331 | 3,89 | | | | | |
| 546 357 | PLUG POWER INC | USD | 2 225 688 | 1,61 | | | | | |
| 18 295 | QUANTA SERVICES INC | USD | 3 574 038 | 2,59 | | | | | |
| 26 973 | REPUBLIC SERVICES INC | USD | 4 026 721 | 2,91 | | | | | |
| 227 062 | SHOALS TECHNOLOGIES GROUP - A | USD | 3 194 264 | 2,31 | | | | | |
| 9 303 | SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 788 269 | 0,57 | | | | | |
| 257 415 | SUNNOVA ENERGY INTERNATIONAL | USD | 3 553 686 | 2,57 | | | | | |
| 5 554 | TESLA INC | USD | 1 249 317 | 0,90 | | | | | |
| 39 537 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 6 410 244 | 4,65 | | | | | |
| 32 220 | XYLEM INC | USD | 3 335 608 | 2,41 | | | | | |
| 30 527 | ZOETIS INC | USD | 5 454 319 | 3,95 | | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | <i>10 108 174</i> | <i>7,31</i> | | | |
| 81 905 | BYD CO LTD-H | HKD | 2 044 271 | 1,48 | | | | | |
| 168 060 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY A | CNY | 3 506 600 | 2,54 | | | | | |
| 39 323 | LI AUTO INC-CLASS A | HKD | 669 997 | 0,48 | | | | | |
| 1 125 554 | NARI TECHNOLOGY CO LTD-A | CNY | 3 207 282 | 2,32 | | | | | |
| 124 584 | NINGBO ORIENT WIRES & CABL - A | CNY | 680 024 | 0,49 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | <i>8 509 923</i> | <i>6,16</i> | | | |
| 8 816 | APTIV PLC | USD | 716 038 | 0,52 | | | | | |
| 332 514 | CERES POWER HOLDINGS PLC | GBP | 701 443 | 0,51 | | | | | |
| 11 945 | LINDE PLC | USD | 4 441 163 | 3,21 | | | | | |
| 31 686 | SSE PLC | GBP | 678 659 | 0,49 | | | | | |
| 259 389 | TATE & LYLE PLC | GBP | 1 972 620 | 1,43 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | <i>6 469 778</i> | <i>4,68</i> | | | |
| 17 562 | ABB LTD-REG | SEK | 702 480 | 0,51 | | | | | |
| 15 542 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 1 429 864 | 1,03 | | | | | |
| 7 499 604 | MEYER BURGER TECHNOLOGY AG | CHF | 1 577 038 | 1,14 | | | | | |
| 21 703 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 2 760 396 | 2,00 | | | | | |
| <i>Corée du Sud</i> | | | | | <i>5 032 802</i> | <i>3,64</i> | | | |
| 7 293 | LG CHEM LTD | KRW | 2 557 247 | 1,85 | | | | | |
| 7 459 | SAMSUNG SDI CO LTD | KRW | 2 475 555 | 1,79 | | | | | |
| <i>Taiwan</i> | | | | | <i>4 334 931</i> | <i>3,14</i> | | | |
| 121 322 | GIANT MANUFACTURING | TWD | 658 388 | 0,48 | | | | | |
| 210 417 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 3 676 543 | 2,66 | | | | | |
| <i>Italie</i> | | | | | <i>3 761 082</i> | <i>2,72</i> | | | |
| 221 461 | ENEL SPA | EUR | 1 490 433 | 1,08 | | | | | |
| 55 153 | PRYSMIAN SPA | EUR | 2 270 649 | 1,64 | | | | | |
| | | | | | <i>Brésil</i> | | | | |
| | | | | | 3 306 078 | 2,39 | | | |
| | | | | | 50 317 | CIA SANEAMENTO BASICO DE SP | BRL | 706 751 | 0,51 |
| | | | | | 2 484 612 | RAIZEN SA - PREFERENCE | BRL | 1 866 023 | 1,35 |
| | | | | | 385 394 | SERENA ENERGIA SA | BRL | 733 304 | 0,53 |
| | | | | | <i>Japon</i> | | | | |
| | | | | | 3 112 909 | 2,25 | | | |
| | | | | | 25 399 | FANUC CORP | JPY | 677 294 | 0,49 |
| | | | | | 68 601 | KURITA WATER INDUSTRIES LTD | JPY | 2 435 615 | 1,76 |
| | | | | | <i>Portugal</i> | | | | |
| | | | | | 2 943 172 | 2,13 | | | |
| | | | | | 646 141 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA | EUR | 2 943 172 | 2,13 |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| | | | | | 2 738 968 | 1,99 | | | |
| | | | | | 3 816 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 672 074 | 0,49 |
| | | | | | 10 891 | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | EUR | 725 994 | 0,53 |
| | | | | | 23 500 | NEOEN SA | EUR | 711 580 | 0,51 |
| | | | | | 22 035 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 629 320 | 0,46 |
| | | | | | <i>Inde</i> | | | | |
| | | | | | 2 558 938 | 1,85 | | | |
| | | | | | 20 482 | KEI INDUSTRIES LTD | INR | 724 613 | 0,52 |
| | | | | | 112 033 | RENEW ENERGY GLOBAL PLC-A | USD | 776 873 | 0,56 |
| | | | | | 224 751 | STERLING AND WILSON RENEWABL | INR | 1 057 452 | 0,77 |
| | | | | | <i>Danemark</i> | | | | |
| | | | | | 2 439 280 | 1,77 | | | |
| | | | | | 16 885 | NOVOZYMES A/S - B | DKK | 840 564 | 0,61 |
| | | | | | 31 840 | ORSTED A/S | DKK | 1 598 716 | 1,16 |
| | | | | | <i>Allemagne</i> | | | | |
| | | | | | 2 432 799 | 1,76 | | | |
| | | | | | 59 807 | SIEMENS ENERGY AG | EUR | 717 684 | 0,52 |
| | | | | | 6 232 | SYMRISE AG | EUR | 620 956 | 0,45 |
| | | | | | 59 304 | THYSSENKRUPP NUCERA AG & CO | EUR | 1 094 159 | 0,79 |
| | | | | | <i>Australie</i> | | | | |
| | | | | | 1 894 942 | 1,37 | | | |
| | | | | | 190 553 | ALLKEM LTD | AUD | 1 189 884 | 0,86 |
| | | | | | 424 277 | CLEANAWAY WASTE MANAGEMENT L | AUD | 705 058 | 0,51 |
| | | | | | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| | | | | | 1 649 754 | 1,19 | | | |
| | | | | | 46 868 | BEFESA SA | EUR | 1 649 754 | 1,19 |
| | | | | | <i>Canada</i> | | | | |
| | | | | | 1 019 051 | 0,74 | | | |
| | | | | | 134 696 | TRANSALTA CORP | CAD | 1 019 051 | 0,74 |
| | | | | | <i>Israël</i> | | | | |
| | | | | | 681 201 | 0,49 | | | |
| | | | | | 39 315 | ENLIGHT RENEWABLE ENERGY LTD | USD | 681 201 | 0,49 |
| | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| | | | | | 16 648 | 0,01 | | | |
| | | | | | 182 | KONINKLIJKE DSM NV | EUR | 16 648 | 0,01 |
| | | | | | 136 042 572 | 98,44 | Total portefeuille-titres | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global Convertible

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations convertibles | | | 525 672 898 | 94,78 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 4 000 000 | 3D SYSTEMS CORP 0,000% 21-15/11/2026 CV | USD | 3 015 220 | 0,54 | 1 300 000 | JP MORGAN CHASE 0,000% 21-18/02/2024 CV | EUR | 1 597 370 | 0,29 |
| 11 000 000 | AIRBNB INC 0,000% 21-15/03/2026 CV | USD | 9 873 753 | 1,78 | 2 500 000 | LUMENTUM HOLDING 0,500% 19-15/12/2026 CV | USD | 2 213 468 | 0,40 |
| 14 700 000 | AKAMAï TECH 0,125% 18-01/05/2025 CV | USD | 18 707 660 | 3,36 | 4 000 000 | LUMENTUM HOLDING 1,500% 23-15/12/2029 CV | USD | 3 989 264 | 0,72 |
| 3 000 000 | ALARM.COM 0,000% 21-15/01/2026 CV | USD | 2 672 502 | 0,48 | 4 000 000 | MARRIOTT VACATIO 0,000% 21-15/01/2026 CV | USD | 3 530 200 | 0,64 |
| 3 000 000 | ALTERYX INC 1,000% 19-01/08/2026 CV | USD | 2 913 609 | 0,53 | 1 250 000 | MERIT MEDICAL SY 3,000% 23-01/02/2029 CV | USD | 1 380 938 | 0,25 |
| 6 000 000 | AMERICAN AIRLINE 6,500% 20-01/07/2025 CV | USD | 6 662 400 | 1,20 | 2 500 000 | MICROCHIP TECHNOLOGY 1,625% 17-15/02/2027 CV | USD | 6 417 200 | 1,16 |
| 5 000 000 | AMERICAN WATER 3,625% 23-15/06/2026 CV | USD | 4 983 775 | 0,90 | 4 000 000 | MIDDLEBY CORP 1,000% 20-01/09/2025 CV | USD | 4 882 360 | 0,88 |
| 2 400 000 | AXON ENTERPRISE 0,500% 22-15/12/2027 CV | USD | 3 028 464 | 0,55 | 4 000 000 | MONGODB INC 0,250% 20-15/01/2026 CV | USD | 7 912 240 | 1,43 |
| 5 000 000 | BENTLEY SYSTEMS 0,125% 21-15/01/2026 CV | USD | 4 954 020 | 0,89 | 5 000 000 | NEXTERA ENGY PTR 2,500% 22-15/06/2026 CV | USD | 4 515 560 | 0,81 |
| 2 500 000 | BENTLEY SYSTEMS 0,375% 21-01/07/2027 CV | USD | 2 239 018 | 0,40 | 3 000 000 | OKTA INC 0,125% 19-01/09/2025 CV | USD | 2 751 381 | 0,50 |
| 6 000 000 | BILL.COM 0,000% 20-01/12/2025 CV | USD | 5 627 760 | 1,01 | 2 143 000 | OKTA INC 0,375% 20-15/06/2026 CV | USD | 1 887 096 | 0,34 |
| 2 500 000 | BIOMARIN PHARM 0,599% 17-01/08/2024 CV | USD | 2 457 965 | 0,44 | 5 000 000 | ON SEMICONDUCTOR 0,000% 21-01/05/2027 CV | USD | 8 183 600 | 1,48 |
| 4 000 000 | BIOMARIN PHARM 1,250% 20-15/05/2027 CV | USD | 4 102 400 | 0,74 | 1 136 000 | ON SEMICONDUCTOR 0,500% 23-01/03/2029 CV | USD | 1 195 379 | 0,22 |
| 1 500 000 | BLOOM ENERGY 3,000% 23-01/06/2028 CV | USD | 1 614 150 | 0,29 | 4 000 000 | ORMAT TECH 2,500% 22-15/07/2027 CV | USD | 4 124 560 | 0,74 |
| 2 000 000 | BOOKING HLDS INC 0,750% 20-01/05/2025 CV | USD | 3 760 760 | 0,68 | 750 000 | PAGERDUTY INC 1,500% 23-15/10/2028 CV | USD | 816 323 | 0,15 |
| 2 000 000 | BOX INC 0,000% 21-15/01/2026 CV | USD | 2 233 760 | 0,40 | 4 500 000 | PEGASYSTEMS INC 0,750% 20-01/03/2025 CV | USD | 4 151 714 | 0,75 |
| 2 500 000 | BRIDGEBIO PHARMA 2,250% 21-01/02/2029 CV | USD | 2 117 420 | 0,38 | 3 000 000 | POST HOLDINGS IN 2,500% 22-15/08/2027 CV | USD | 3 054 720 | 0,55 |
| 2 000 000 | CHEGG INC 0,125% 19-15/03/2025 CV | USD | 1 837 258 | 0,33 | 5 000 000 | REALOGY GRP / CO 0,250% 21-15/06/2026 CV | USD | 3 894 905 | 0,70 |
| 5 000 000 | CLOUDFLARE 0,000% 21-15/08/2026 CV | USD | 4 505 460 | 0,81 | 4 000 000 | REDFIN CORP 0,000% 20-15/10/2025 CV | USD | 3 350 548 | 0,60 |
| 4 500 000 | DATADOG INC 0,125% 20-15/06/2025 CV | USD | 6 312 960 | 1,14 | 6 000 000 | RINGCENTRAL INC 0,000% 20-01/03/2025 CV | USD | 5 574 588 | 1,01 |
| 4 000 000 | DEXCOM INC 0,250% 20-15/11/2025 CV | USD | 4 174 400 | 0,75 | 3 000 000 | RIVIAN AUTO INC 4,625% 23-15/03/2029 CV | USD | 4 193 790 | 0,76 |
| 6 000 000 | DIGITALOCEAN HLD 0,000% 21-01/12/2026 CV | USD | 4 917 672 | 0,89 | 2 500 000 | SNAP INC 0,000% 21-01/05/2027 CV | USD | 2 002 518 | 0,36 |
| 8 500 000 | DROPBOX 0,000% 21-01/03/2026 CV | USD | 8 330 850 | 1,50 | 6 000 000 | SOUTHWEST AIR 1,250% 20-01/05/2025 CV | USD | 6 055 980 | 1,09 |
| 1 500 000 | DROPBOX 0,000% 21-01/03/2028 CV | USD | 1 502 580 | 0,27 | 3 000 000 | SPLUNK INC 1,125% 18-15/09/2025 CV | USD | 3 290 460 | 0,59 |
| 15 000 000 | DUKE ENERGY COR 4,125% 23-15/04/2026 CV | USD | 14 992 559 | 2,69 | 3 333 000 | SPLUNK INC 1,125% 20-15/06/2027 CV | USD | 3 214 685 | 0,58 |
| 8 000 000 | ENPHASE ENERGY 0,000% 21-01/03/2026 CV | USD | 7 315 296 | 1,32 | 2 500 000 | SQUARE INC 0,125% 20-01/03/2025 CV | USD | 2 431 215 | 0,44 |
| 3 500 000 | ENVESTNET INC 0,750% 20-15/08/2025 CV | USD | 3 252 862 | 0,59 | 3 600 000 | TYLER TECHNOLOG 0,250% 21-15/03/2026 CV | USD | 3 635 604 | 0,66 |
| 2 500 000 | ETSY INC 0,125% 19-01/10/2026 CV | USD | 2 875 100 | 0,52 | 1 250 000 | UBER TECHNOLOGIE 0,875% 23-01/12/2028 CV | USD | 1 361 938 | 0,25 |
| 6 000 000 | ETSY INC 0,250% 21-15/06/2028 CV | USD | 4 789 692 | 0,86 | 3 077 000 | UNDER ARMOUR INC 1,500% 20-01/06/2024 CV | USD | 3 120 632 | 0,56 |
| 4 800 000 | EURONET WORLDWID 0,750% 19-15/03/2049 CV | USD | 4 499 074 | 0,81 | 7 000 000 | UNITY SOFTWARE I 0,000% 21-15/11/2026 CV | USD | 5 825 932 | 1,05 |
| 2 000 000 | EVERBRIDGE INC 0,125% 19-15/12/2024 CV | USD | 1 870 834 | 0,34 | 3 000 000 | VAIL RESORTS 0,000% 20-01/01/2026 CV | USD | 2 631 216 | 0,47 |
| 5 000 000 | EXACT SCIENCES 0,375% 20-01/03/2028 CV | USD | 4 668 165 | 0,84 | 2 500 000 | VISHAY INTERTECH 2,250% 23-15/09/2030 CV | USD | 2 462 295 | 0,44 |
| 2 000 000 | EXACT SCIENCES 1,000% 18-15/01/2025 CV | USD | 2 277 880 | 0,41 | 4 000 000 | WAYFAIR INC 0,625% 20-01/10/2025 CV | USD | 3 597 908 | 0,65 |
| 4 000 000 | EXPEDIA GRP INC 0,000% 21-15/02/2026 CV | USD | 3 777 568 | 0,68 | 5 000 000 | WELLTOWER OP LLC 2,750% 23-15/05/2028 CV | USD | 5 507 350 | 0,99 |
| 8 000 000 | FORD MOTOR CO 0,000% 21-15/03/2026 CV | USD | 7 966 248 | 1,44 | 5 500 000 | WESTERN DIGITAL 3,000% 23-15/11/2028 CV | USD | 6 720 395 | 1,21 |
| 5 000 000 | HAEMONETICS CORP 0,000% 21-01/03/2026 CV | USD | 4 433 925 | 0,80 | 14 000 000 | WOLFSPEED INC 1,875% 22-01/12/2029 CV | USD | 9 393 495 | 1,69 |
| 2 000 000 | HAT HOLDINGS I 3,750% 23-15/08/2028 CV | USD | 2 347 060 | 0,42 | 1 000 000 | WORKIVA INC 1,250% 23-15/08/2028 CV | USD | 1 016 640 | 0,18 |
| 3 500 000 | IAC FINANCECO 2 0,875% 19-15/06/2026 CV | USD | 3 128 020 | 0,56 | 6 000 000 | ZSCALER INC 0,125% 20-01/07/2025 CV | USD | 9 099 720 | 1,64 |
| 1 975 000 | INSMED INC 1,750% 18-15/01/2025 CV | USD | 2 083 349 | 0,38 | <i>France</i> | | | | |
| 4 000 000 | INSULET CORP 0,375% 19-01/09/2026 CV | USD | 4 599 120 | 0,83 | 2 400 000 | BNP PARIBAS 0,000% 22-13/05/2025 CV | EUR | 3 178 131 | 0,57 |
| 4 500 000 | INTEGRA LIFESCIE 0,500% 20-15/08/2025 CV | USD | 4 226 382 | 0,76 | 49 740 | EDENRED 0,000% 19-06/09/2024 CV | EUR | 3 323 146 | 0,60 |
| 2 500 000 | IONIS PHARMACEUT 1,750% 23-15/06/2028 CV | USD | 2 871 300 | 0,52 | 2 800 000 | ELIS SA 2,250% 22-22/09/2029 CV | EUR | 3 971 376 | 0,72 |
| 1 800 000 | JP MORGAN CHASE 0,000% 21-10/06/2024 CV | EUR | 2 030 762 | 0,37 | 23 223 | SAFRAN SA 0,000% 21-01/04/2028 CV | EUR | 4 786 339 | 0,86 |
| | | | | | 12 584 | SCHNEIDER 0,000% 20-15/06/2026 CV FLAT | EUR | 2 711 999 | 0,49 |
| | | | | | 1 800 000 | SCHNEIDER ELEC 1,970% 23-27/11/2030 CV | EUR | 2 142 489 | 0,39 |
| | | | | | 2 200 000 | SPIE SA 2,000% 23-17/01/2028 CV | EUR | 2 521 801 | 0,45 |
| | | | | | 1 300 000 | UBISOFT ENTERTAI 2,375% 22-15/11/2028 CV | EUR | 1 400 704 | 0,25 |
| | | | | | 24 035 985 | | | | 4,33 |

BNP PARIBAS FUNDS Global Convertible

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|---------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|---|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Japon | | | | | Singapour | | | | |
| 600 000 000 | DMG MORI CO LTD 0,000% 21-16/07/2024 CV | JPY | 4 751 015 | 0,86 | 1 500 000 | SGX TREASURY 0,000% 21-01/03/2024 CV | EUR | 1 637 274 | 0,30 |
| 80 000 000 | JFE HOLDINGS 0,000% 23-28/09/2028 CV | JPY | 592 356 | 0,11 | 4 000 000 | SINGAPORE AIR 1,625% 20-03/12/2025 CV | SGD | 3 847 364 | 0,69 |
| 880 000 000 | mitsubishi chemical 0,000% 17-29/03/2024 CV | JPY | 6 226 790 | 1,12 | Emirats Arabes Unis | | | | |
| 240 000 000 | NIPRO CORP 0,000% 21-25/09/2026 CV | JPY | 1 718 440 | 0,31 | 4 400 000 | ABU DHABI NAT 0,700% 21-04/06/2024 CV | USD | 4 283 048 | 0,77 |
| 300 000 000 | NTN CORP 0,000% -19/12/2025 CV | JPY | 2 163 754 | 0,39 | Israël | | | | |
| 200 000 000 | PARK24 CO LTD 0,000% 23-24/02/2028 CV | JPY | 1 392 183 | 0,25 | 3 000 000 | CYBERARK SFTWARE 0,000% 19-15/11/2024 CV | USD | 4 255 626 | 0,77 |
| 300 000 000 | ROHM COMPANY LTD 0,000% 19-05/12/2024 CV | JPY | 2 167 265 | 0,39 | Canada | | | | |
| 670 000 000 | TOKYU CORP 0,000% 23-29/09/2028 CV | JPY | 4 843 504 | 0,87 | 4 000 000 | SHOPIFY INC 0,125% 20-01/11/2025 CV | USD | 3 770 012 | 0,68 |
| Allemagne | | | | | Chine | | | | |
| 2 400 000 | BECHTLE AG 2,000% 23-08/12/2030 CV | EUR | 2 802 939 | 0,51 | 2 000 000 | LI AUTO INC 0,250% 21-01/05/2028 CV | USD | 2 935 400 | 0,53 |
| 2 700 000 | DELIVERY HERO AG 3,250% 23-21/02/2030 CV | EUR | 2 557 541 | 0,46 | Ile de Jersey | | | | |
| 2 500 000 | DEUTSCHE POST AG 0,050% 17-30/06/2025 CV | EUR | 2 699 019 | 0,49 | 3 000 000 | NOVOCURE LTD 0,000% 20-01/11/2025 CV | USD | 2 597 406 | 0,47 |
| 2 600 000 | DT LUFTHANSA AG 2,000% 20-17/11/2025 CV | EUR | 3 082 097 | 0,56 | Vietnam | | | | |
| 2 100 000 | LEG IMMOBILIEN SE 0,400% 20-30/06/2028 CV | EUR | 1 988 155 | 0,36 | 2 600 000 | VINGROUP JSC 3,000% 21-20/04/2026 CV | USD | 2 502 500 | 0,45 |
| 3 300 000 | RAG STIFTUNG 1,875% 22-16/11/2029 CV | EUR | 3 766 881 | 0,68 | Iles Caïmans | | | | |
| 2 700 000 | RHEINMETALL 1,875% 23-07/02/2028 CV | EUR | 3 317 675 | 0,60 | 16 000 000 | CATHAY PAC FIN 2,750% 21-05/02/2026 CV | HKD | 2 142 996 | 0,39 |
| 2 700 000 | RHEINMETALL 2,250% 23-07/02/2030 CV | EUR | 3 398 860 | 0,61 | Mexique | | | | |
| Corée du Sud | | | | | 1 000 000 | FEMSA 2,625% 23-24/02/2026 CV | EUR | 1 103 457 | 0,20 |
| 900 000 | LG CHEM LTD 1,250% 23-18/07/2028 CV | USD | 859 950 | 0,16 | Macao | | | | |
| 2 700 000 | LG CHEM LTD 1,600% 23-18/07/2030 CV | USD | 2 529 549 | 0,46 | 1 000 000 | WYNN MACAU LTD 4,500% 23-07/03/2029 CV | USD | 1 018 375 | 0,18 |
| 9 000 000 | SK HYNIX INC 1,750% 23-11/04/2030 CV | USD | 12 464 999 | 2,25 | Royaume-Uni | | | | |
| Italie | | | | | 1 500 000 | FARFETCH LTD 3,750% 20-01/05/2027 CV | USD | 16 875 | 0,00 |
| 3 800 000 | ENI SPA 2,950% 23-14/09/2030 CV | EUR | 4 404 531 | 0,79 | 800 000 | OCADO GROUP PLC 0,750% 20-18/01/2027 CV | GBP | 797 372 | 0,14 |
| 2 900 000 | PRYSMIAN SPA 0,000% 21-02/02/2026 CV | EUR | 3 530 817 | 0,64 | Autres valeurs mobilières | | | | |
| 2 600 000 | SAIPEM SPA 2,875% 23-11/09/2029 CV | EUR | 3 080 948 | 0,56 | Obligations convertibles | | | | |
| Pays-Bas | | | | | Luxembourg | | | | |
| 5 400 000 | AMERICA MOVIL BV 0,000% 21-02/03/2024 CV | EUR | 5 969 882 | 1,08 | 33 800 000 | ESPIRITO SANTO 5,050% 05-31/12/2049 CV SR DFLT | EUR | 186 686 | 0,03 |
| 1 300 000 | JUST EAT TAKEA 0,625% 21-09/02/2028 CV | EUR | 1 074 880 | 0,19 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 2 200 000 | QIAGEN NV 1,000% 18-13/11/2024 CV | USD | 2 254 868 | 0,41 | Luxembourg | | | | |
| Suisse | | | | | 49 866,60 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D 1 VNAV - X CAP | USD | 7 014 525 | 1,26 |
| 3 200 000 | STMICROELECTRON 0,000% 20-04/08/2025 CV | USD | 3 854 720 | 0,69 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 4 200 000 | STMICROELECTRON 0,000% 20-04/08/2027 CV | USD | 5 050 836 | 0,91 | 532 874 109 96,07 | | | | |
| Inde | | | | | | | | | |
| 5 000 000 | BHARTI AIRTEL 1,500% 20-17/02/2025 CV | USD | 8 350 000 | 1,51 | | | | | |
| Espagne | | | | | | | | | |
| 3 800 000 | CELLNEX TELECOM 0,500% 19-05/07/2028 CV | EUR | 4 468 000 | 0,81 | | | | | |
| 3 200 000 | CELLNEX TELECOM 2,125% 23-11/08/2030 CV | EUR | 3 631 488 | 0,65 | | | | | |
| Hong-Kong | | | | | | | | | |
| 4 500 000 | ANLLIAN CAPITAL 0,000% 20-05/02/2025 CV | EUR | 4 912 517 | 0,89 | | | | | |
| 2 500 000 | BOSIDENG INTERNA 1,000% 19-17/12/2024 CV | USD | 2 531 550 | 0,46 | | | | | |
| Irlande | | | | | | | | | |
| 7 000 000 | JAZZ INVT I LTD 1,500% 17-15/08/2024 CV | USD | 6 755 000 | 1,22 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global Enhanced Bond 36M

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|-------------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | | | 132 743 256 | 82,48 | | | | | |
| Obligations | | | | | 84 762 934 52,67 | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | <i>16 959 934 10,52</i> | | | | |
| 300 000 | AT&T INC 0,250% 19-04/03/2026 | EUR | 281 464 | 0,17 | 1 541 223 | GNR 2021-57 IB 2,500% 21-20/02/2051 | USD | 188 493 | 0,12 |
| 200 000 | BAXTER INTERNATIONAL 0,400% 19-15/05/2024 | EUR | 197 292 | 0,12 | 2 026 340 | GNR 2021-57 IN 2,000% 21-20/02/2051 | USD | 198 461 | 0,12 |
| 362 000 | BOOKING HLDS INC 4,500% 22-15/11/2031 | EUR | 394 018 | 0,24 | 5 201 850 | GNR 2021-7 AI 2,000% 21-20/01/2051 | USD | 485 550 | 0,30 |
| 2 518 370 | FHR 4122 PI 4,500% 12-15/02/2042 | USD | 184 549 | 0,11 | 333 808 | GNR 2022-10 IF 3,000% 22-20/11/2051 | USD | 38 544 | 0,02 |
| 1 657 122 | FHR 4317 TI 4,500% 14-15/12/2042 | USD | 258 593 | 0,16 | 2 376 422 | GNR 2022-159 IG 3,500% 22-20/02/2052 | USD | 377 207 | 0,23 |
| 2 556 763 | FHR 4648 KI 4,500% 17-15/08/2044 | USD | 426 571 | 0,27 | 3 049 431 | GNR 2022-18 CI 3,000% 22-20/01/2052 | USD | 433 847 | 0,27 |
| 2 047 578 | FHR 5038 KI 2,000% 20-25/11/2050 | USD | 236 093 | 0,15 | 174 000 | IBM CORP 3,375% 23-06/02/2027 | EUR | 176 030 | 0,11 |
| 1 506 349 | FHR 5038 PI 2,000% 20-25/11/2050 | USD | 174 028 | 0,11 | 100 000 | IHG FINANCE LLC 4,375% 23-28/11/2029 | EUR | 103 575 | 0,06 |
| 641 800 | FHR 5039 CI 2,000% 20-25/11/2050 | USD | 68 581 | 0,04 | 100 000 | KRAFT HEINZ FOOD 2,250% 16-25/05/2028 | EUR | 96 529 | 0,06 |
| 567 926 | FHR 5050 IE 2,000% 20-25/12/2050 | USD | 57 859 | 0,04 | 400 000 | MCDONALDS CORP 1,500% 17-28/11/2029 | EUR | 365 494 | 0,23 |
| 1 212 325 | FHR 5050 IP 3,000% 20-25/10/2050 | USD | 179 305 | 0,11 | 141 000 | TOYOTA MTR CREDIT 4,050% 23-13/09/2029 | EUR | 147 827 | 0,09 |
| 4 428 014 | FHR 5053 MI 2,000% 20-25/12/2050 | USD | 529 285 | 0,33 | 200 000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1,375% 17-27/10/2026 | EUR | 191 236 | 0,12 |
| 3 054 429 | FHR 5064 NI 2,000% 20-25/06/2050 | USD | 286 157 | 0,18 | <i>France</i> | | | | |
| 402 182 | FHR 5065 NI 2,500% 20-25/01/2051 | USD | 58 857 | 0,04 | 100 000 | AIR FRANCE-KLM 3,000% 21-01/07/2024 | EUR | 98 960 | 0,06 |
| 638 226 | FHR 5072 IQ 3,500% 21-25/10/2050 | USD | 99 843 | 0,06 | 100 000 | AIR FRANCE-KLM 7,250% 23-31/05/2026 | EUR | 106 543 | 0,07 |
| 3 099 934 | FHR 5145 HI 3,000% 21-25/09/2051 | USD | 432 781 | 0,27 | 100 000 | BNP PARIBAS 1,000% 17-29/11/2024 | EUR | 97 100 | 0,06 |
| 2 717 888 | FHS 304 C19 5,000% 13-15/06/2042 | USD | 486 102 | 0,30 | 100 000 | CARMILA SA 1,625% 20-30/05/2027 | EUR | 92 215 | 0,06 |
| 1 211 915 | FHS 365 C50 4,500% 19-15/05/2049 | USD | 209 766 | 0,13 | 200 000 | CARREFOUR BANQUE 0,107% 21-14/06/2025 | EUR | 190 316 | 0,12 |
| 1 385 396 | FHS 386 C3 2,500% 22-15/03/2052 | USD | 192 788 | 0,12 | 100 000 | CARREFOUR SA 3,750% 23-10/10/2030 | EUR | 101 952 | 0,06 |
| 2 894 467 | FHS 397 C52 500% 23-25/01/2053 | USD | 554 604 | 0,34 | 100 000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES 5,875% 23-25/10/2033 | EUR | 109 614 | 0,07 |
| 1 665 554 | FNR 2018-24 IC 4,500% 18-25/04/2048 | USD | 319 586 | 0,20 | 100 000 | DANONE 3,470% 23-22/05/2031 | EUR | 102 576 | 0,06 |
| 633 829 | FNR 2020-100 BI 2,000% 20-25/01/2051 | USD | 72 377 | 0,04 | 7 740 000 | FRANCE O.A.T. 0,000% 18-25/03/2024 | EUR | 7 676 532 | 4,78 |
| 4 447 271 | FNR 2020-62 AI 2,500% 20-25/09/2050 | USD | 692 607 | 0,43 | 1 294 524 | FRANCE O.A.T. I/L 0,100% 15-01/03/2025 | EUR | 1 276 139 | 0,79 |
| 489 623 | FNR 2020-62 HI 2,000% 20-25/09/2050 | USD | 56 992 | 0,04 | 629 450 | FRANCE O.A.T. I/L 0,250% 13-25/07/2024 | EUR | 625 313 | 0,39 |
| 2 951 138 | FNR 2020-62 IO 2,500% 20-25/09/2050 | USD | 431 724 | 0,27 | 100 000 | IMERYS SA 2,000% 14-10/12/2024 | EUR | 97 943 | 0,06 |
| 423 565 | FNR 2020-68 QI 3,000% 20-25/10/2050 | USD | 71 442 | 0,04 | 100 000 | IMERYS SA 4,750% 23-29/11/2029 | EUR | 101 578 | 0,06 |
| 4 437 681 | FNR 2020-75 BI 2,000% 20-25/11/2050 | USD | 510 595 | 0,32 | 100 000 | RCI BANQUE 1,625% 17-11/04/2025 | EUR | 97 534 | 0,06 |
| 599 382 | FNR 2020-75 KI 2,000% 20-25/11/2050 | USD | 64 672 | 0,04 | 73 000 | RCI BANQUE 4,625% 23-02/10/2026 | EUR | 74 831 | 0,05 |
| 681 414 | FNR 2021-10 BI 2,000% 21-25/03/2051 | USD | 71 062 | 0,04 | 120 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-14/06/2028 | EUR | 126 128 | 0,08 |
| 596 896 | FNR 2021-18 LI 2,000% 21-25/04/2051 | USD | 65 901 | 0,04 | 100 000 | RENAULT 1,250% 19-24/06/2025 | EUR | 95 850 | 0,06 |
| 3 902 372 | FNR 2021-2 NI 2,000% 21-25/02/2051 | USD | 466 384 | 0,29 | 100 000 | SUEZ 1,875% 22-24/05/2027 | EUR | 95 619 | 0,06 |
| 2 222 662 | FNR 2021-3 QI 2,500% 21-25/02/2051 | USD | 305 778 | 0,19 | 200 000 | TEREOS FIN GROUP 4,750% 22-30/04/2027 | EUR | 200 969 | 0,12 |
| 1 937 666 | FNR 2022-4 HI 2,500% 22-25/02/2052 | USD | 286 409 | 0,18 | 211 000 | TEREOS FIN GROUP 7,250% 23-15/04/2028 | EUR | 223 188 | 0,14 |
| 269 129 | FNR 2022-7 GI 3,000% 22-25/07/2050 | USD | 38 465 | 0,02 | 100 000 | THALES SA 4,250% 23-18/10/2031 | EUR | 106 187 | 0,07 |
| 1 315 786 | FNS 413 C39 4,500% 12-25/04/2041 | USD | 234 677 | 0,15 | 100 000 | VALEO SA 3,250% 14-22/01/2024 | EUR | 99 853 | 0,06 |
| 1 598 603 | FNS 422 C9 3,000% 16-25/12/2045 | USD | 188 652 | 0,12 | <i>Royaume-Uni</i> | | | | |
| 2 901 962 | FNS 434 C25 5,000% 23-25/06/2053 | USD | 604 693 | 0,38 | 131 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 134 748 | 0,08 |
| 2 737 862 | FNS 434 C37 4,000% 23-25/06/2053 | USD | 520 136 | 0,32 | 100 000 | HEATHROW FNDG 1,500% 20-12/10/2025 | EUR | 96 743 | 0,06 |
| 344 000 | FORD MOTOR CREDIT 4,867% 23-03/08/2027 | EUR | 353 522 | 0,22 | 300 000 | INTERNATIONAL CONSOLIDAT 3,750% 21-25/03/2029 | EUR | 290 253 | 0,18 |
| 167 000 | GENERAL MOTORS FIN 4,500% 23-22/11/2027 | EUR | 172 913 | 0,11 | 200 000 | ROLLS-ROYCE PLC 1,625% 18-09/05/2028 | EUR | 184 098 | 0,11 |
| 2 175 646 | GNR 2013-170 IG 5,500% 13-16/11/2043 | USD | 307 129 | 0,19 | 300 000 | ROLLS-ROYCE PLC 4,625% 20-16/02/2026 | EUR | 304 691 | 0,19 |
| 1 253 206 | GNR 2017-26 MI 5,000% 17-20/11/2039 | USD | 209 789 | 0,13 | 151 000 | TESCO CORP TREAS 4,250% 23-27/02/2031 | EUR | 156 787 | 0,10 |
| 2 409 328 | GNR 2017-42 IC 4,500% 17-20/08/2041 | USD | 385 388 | 0,24 | 8 590 000 | UK TREASURY GILT 3,750% 23-22/10/2053 | GBP | 9 248 003 | 5,76 |
| 130 129 | GNR 2017-79 IB 5,500% 17-20/05/2047 | USD | 22 026 | 0,01 | <i>Italie</i> | | | | |
| 533 564 | GNR 2020-127 IK 2,500% 20-20/08/2050 | USD | 63 691 | 0,04 | 100 000 | AEROPORTI ROMA 4,875% 23-10/07/2033 | EUR | 105 209 | 0,07 |
| 301 334 | GNR 2020-129 IE 2,500% 20-20/09/2050 | USD | 36 982 | 0,02 | 200 000 | ASSICURAZIONI 5,399% 23-20/04/2033 | EUR | 211 404 | 0,13 |
| 1 623 348 | GNR 2020-160 IY 2,500% 20-20/10/2050 | USD | 192 630 | 0,12 | 100 000 | FERROVIE DEL 4,500% 23-23/05/2033 | EUR | 104 604 | 0,07 |
| 2 125 679 | GNR 2020-160 YI 2,500% 20-20/10/2050 | USD | 258 280 | 0,16 | 100 000 | HERA SPA 4,250% 23-20/04/2033 | EUR | 103 663 | 0,06 |
| 1 228 809 | GNR 2021-104 NI 2,500% 21-20/06/2051 | USD | 123 109 | 0,08 | 150 000 | ITALGAS SPA 4,125% 23-08/06/2032 | EUR | 154 960 | 0,10 |
| 63 937 | GNR 2021-107 IH 3,000% 21-20/02/2050 | USD | 15 251 | 0,01 | 7 690 000 | ITALY BTPS 0,000% 20-15/01/2024 | EUR | 7 679 542 | 4,78 |
| 4 776 985 | GNR 2021-140 IH 2,500% 21-20/08/2051 | USD | 576 591 | 0,36 | 131 000 | SNAM 4,000% 23-27/11/2029 | EUR | 134 890 | 0,08 |
| 1 442 194 | GNR 2021-158 NI 3,000% 21-20/09/2051 | USD | 193 407 | 0,12 | | | | | |
| 2 509 641 | GNR 2021-188 IW 3,000% 21-20/10/2051 | USD | 339 579 | 0,21 | | | | | |
| 5 670 353 | GNR 2021-24 TI 2,000% 21-20/02/2051 | USD | 596 166 | 0,37 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global Enhanced Bond 36M

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Afrique du Sud</i> | | <i>5 329 628</i> | <i>3,32</i> | | <i>Finlande</i> | | <i>517 424</i> | <i>0,32</i> |
| 123 300 000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 8,250% 13-31/03/2032 | ZAR | 5 329 628 | 3,32 | 200 000 | NOKIA OYJ 4,375% 23-21/08/2031 | EUR | 201 094 | 0,12 |
| | <i>Portugal</i> | | <i>4 560 875</i> | <i>2,84</i> | 313 000 | STORA ENSO OYJ 4,000% 23-01/06/2026 | EUR | 316 330 | 0,20 |
| 4 550 000 | PORTUGUESE OTS 5,650% 13-15/02/2024 | EUR | 4 560 875 | 2,84 | | <i>Colombie</i> | | <i>510 775</i> | <i>0,32</i> |
| | <i>Mexique</i> | | <i>4 322 947</i> | <i>2,69</i> | 710 000 | REPUBLIC OF COLOMBIA 3,250% 21-22/04/2032 | USD | 510 775 | 0,32 |
| 89 000 000 | MEXICAN BONOS 7,500% 22-26/05/2033 | MXN | 4 322 947 | 2,69 | | <i>Suède</i> | | <i>378 951</i> | <i>0,23</i> |
| | <i>Japon</i> | | <i>3 513 553</i> | <i>2,18</i> | 300 000 | ERICSSON LM 1,125% 22-08/02/2027 | EUR | 276 938 | 0,17 |
| 100 000 | ASAHI GROUP 0,010% 21-19/04/2024 | EUR | 98 803 | 0,06 | 100 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 3,875% 23-10/05/2027 | EUR | 102 013 | 0,06 |
| 472 250 000 | JAPAN GOVERNMENT 30-YR 1,800% 23-20/09/2053 | JPY | 3 126 671 | 1,94 | | <i>Côte d'Ivoire</i> | | <i>361 469</i> | <i>0,22</i> |
| 300 000 | NISSAN MOTOR CO 3,201% 20-17/09/2028 | EUR | 288 079 | 0,18 | 430 000 | IVORY COAST-PDI 4,875% 20-30/01/2032 | EUR | 361 469 | 0,22 |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>3 358 317</i> | <i>2,10</i> | | <i>Serbie</i> | | <i>333 355</i> | <i>0,21</i> |
| 100 000 | COCA-COLA HBC BV 2,750% 22-23/09/2025 | EUR | 99 022 | 0,06 | 360 000 | SERBIA REPUBLIC 6,500% 23-26/09/2033 | USD | 333 355 | 0,21 |
| 300 000 | DAIMLER TRUCK 3,875% 23-19/06/2026 | EUR | 304 911 | 0,19 | | <i>Rép. dominicaine</i> | | <i>329 205</i> | <i>0,20</i> |
| 200 000 | EASYJET FINCO 1,875% 21-03/03/2028 | EUR | 186 678 | 0,12 | 400 000 | REPUBLIC OF DOMINICAN 4,875% 20-23/09/2032 | USD | 329 205 | 0,20 |
| 122 000 | HEIMSTADEN BOST 0,250% 21-13/10/2024 | EUR | 114 753 | 0,07 | | <i>Bolivie</i> | | <i>248 350</i> | <i>0,15</i> |
| 100 000 | HEINEKEN NV 3,625% 23-15/11/2026 | EUR | 101 548 | 0,06 | 580 000 | BOLIVIA GOVERNMENT 4,500% 17-20/03/2028 | USD | 248 350 | 0,15 |
| 100 000 | HM FINANCE 4,875% 23-25/10/2031 | EUR | 106 733 | 0,07 | | <i>Egypte</i> | | <i>200 516</i> | <i>0,12</i> |
| 1 830 000 | ING GROEP NV 6,500% 15-29/12/2049 | USD | 1 620 662 | 1,01 | 320 000 | ARAB REP EGYPT 7,625% 20-29/05/2032 | USD | 200 516 | 0,12 |
| 100 000 | JDE PEETS NV 4,500% 23-23/01/2034 | EUR | 105 014 | 0,07 | | <i>Espagne</i> | | <i>198 090</i> | <i>0,12</i> |
| 113 000 | SANDOZ FINANCE 4,500% 23-17/11/2033 | EUR | 119 759 | 0,07 | 200 000 | AMADEUS IT GROUP 2,875% 20-20/05/2027 | EUR | 198 090 | 0,12 |
| 259 000 | STELLANTIS NV 4,250% 23-16/06/2031 | EUR | 268 460 | 0,17 | | <i>Chine</i> | | <i>167 134</i> | <i>0,11</i> |
| 162 000 | STELLANTIS NV 4,375% 23-14/03/2030 | EUR | 170 889 | 0,11 | 1 000 000 | COUNTRY GARDEN 3,125% 20-22/10/2025 | USD | 72 421 | 0,05 |
| 157 000 | TOYOTA MOTOR FIN 3,500% 23-13/01/2028 | EUR | 159 888 | 0,10 | 1 350 000 | COUNTRY GARDEN 4,200% 20-06/02/2026 | USD | 94 713 | 0,06 |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>3 175 378</i> | <i>1,97</i> | | <i>Danemark</i> | | <i>103 564</i> | <i>0,06</i> |
| 2 410 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 1,000% 15-15/08/2025 | EUR | 2 351 582 | 1,46 | 100 000 | CARLSBERG BREW 4,000% 23-05/10/2028 | EUR | 103 564 | 0,06 |
| 100 000 | DT LUFTHANSA AG 2,875% 21-11/02/2025 | EUR | 98 000 | 0,06 | | <i>Cameroun</i> | | <i>84 489</i> | <i>0,05</i> |
| 200 000 | DT LUFTHANSA AG 2,875% 21-16/05/2027 | EUR | 192 455 | 0,12 | 115 000 | REPUBLIC OF CAMEROON 5,950% 21-07/07/2032 | EUR | 84 489 | 0,05 |
| 223 000 | FRESENIUS SE & C 1,875% 22-24/05/2025 | EUR | 217 992 | 0,14 | | Obligations à taux flottant | | 14 058 628 | 8,71 |
| 200 000 | ROBERT BOSCH 4,000% 23-02/06/2035 | EUR | 211 772 | 0,13 | | <i>Espagne</i> | | <i>5 070 309</i> | <i>3,15</i> |
| 100 000 | VONOVIA SE 4,750% 22-23/05/2027 | EUR | 103 577 | 0,06 | 1 800 000 | BANCO SANTANDER 19-31/12/2049 FRN | USD | 1 628 090 | 1,01 |
| | <i>Pérou</i> | | <i>2 935 047</i> | <i>1,82</i> | 100 000 | BANCO SANTANDER 23-23/08/2033 FRN | EUR | 104 745 | 0,07 |
| 11 490 000 | REPUBLIC OF PERU 7,300% 23-12/08/2033 | PEN | 2 935 047 | 1,82 | 1 600 000 | CAIXABANK 17-31/12/2049 FRN | EUR | 1 596 099 | 0,99 |
| | <i>Roumanie</i> | | <i>2 521 177</i> | <i>1,57</i> | 1 800 000 | CAIXABANK 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 741 375 | 1,08 |
| 100 000 | ROMANIA 3,625% 14-24/04/2024 | EUR | 99 821 | 0,06 | | <i>Italie</i> | | <i>3 463 745</i> | <i>2,15</i> |
| 11 760 000 | ROMANIA 6,700% 22-25/02/2032 | RON | 2 421 356 | 1,51 | 161 000 | ENEL SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 140 348 | 0,09 |
| | <i>Grèce</i> | | <i>1 998 620</i> | <i>1,24</i> | 710 000 | INTESA SANPAOLO 20-01/03/2169 FRN | EUR | 639 595 | 0,40 |
| 2 000 000 | HELLENIC REP 3,450% 19-02/04/2024 | EUR | 1 998 620 | 1,24 | 100 000 | INTESA SANPAOLO 23-16/11/2025 FRN | EUR | 100 198 | 0,06 |
| | <i>Bahreïn</i> | | <i>675 587</i> | <i>0,42</i> | 1 000 000 | ITALY CCTS EU 22-15/10/2030 FRN | EUR | 984 277 | 0,61 |
| 840 000 | BAHRAIN 5,250% 21-25/01/2033 | USD | 675 587 | 0,42 | 1 400 000 | ITALY CCTS EU 23-15/10/2028 FRN | EUR | 1 404 371 | 0,87 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>675 388</i> | <i>0,41</i> | 200 000 | UNICREDIT SPA 19-23/09/2029 FRN | EUR | 194 956 | 0,12 |
| 100 000 | AIB GROUP PLC 2,250% 18-03/07/2025 | EUR | 98 245 | 0,06 | | <i>Belgique</i> | | <i>2 917 574</i> | <i>1,81</i> |
| 200 000 | DELL BANK INTERN 1,625% 20-24/06/2024 | EUR | 197 658 | 0,12 | 3 400 000 | BELFIUS BANK SA 18-31/12/2049 FRN | EUR | 2 917 574 | 1,81 |
| 100 000 | FCA BANK IE 0,500% 19-13/09/2024 | EUR | 97 548 | 0,06 | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>815 206</i> | <i>0,50</i> |
| 100 000 | SMURFIT KAPPA 0,500% 21-22/09/2029 | EUR | 85 289 | 0,05 | 100 000 | COOPERATIEVE RAB 23-03/11/2026 FRN | EUR | 100 593 | 0,06 |
| 200 000 | SMURFIT KAPPA AQ 2,750% 15-01/02/2025 | EUR | 196 648 | 0,12 | 100 000 | ING BANK NV 23-02/10/2026 FRN | EUR | 100 442 | 0,06 |
| | <i>Sénégal</i> | | <i>596 626</i> | <i>0,37</i> | 840 000 | ING GROEP NV 21-31/12/2061 FRN | USD | 614 171 | 0,38 |
| 740 000 | REPUBLIC OF SENEGAL 6,250% 17-23/05/2033 | USD | 596 626 | 0,37 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global Enhanced Bond 36M

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Royaume-Uni</i> | | 587 076 | 0,36 | | | | | |
| 400 000 | BP CAPITAL PLC 20-22/06/2169 FRN | EUR | 373 381 | 0,23 | | | | | |
| 200 000 | VODAFONE GROUP 23-30/08/2084 FRN | EUR | 213 695 | 0,13 | | | | | |
| | <i>France</i> | | 503 217 | 0,31 | | | | | |
| 200 000 | ACCOR 19-31/12/2059 FRN | EUR | 194 517 | 0,12 | | | | | |
| 100 000 | ACCOR 23-11/04/2172 FRN | EUR | 108 482 | 0,07 | | | | | |
| 200 000 | RCI BANQUE 17-04/11/2024 FRN | EUR | 200 218 | 0,12 | | | | | |
| | <i>Canada</i> | | 300 602 | 0,19 | | | | | |
| 300 000 | TORONTO DOMINION BANK 23-21/07/2025 FRN | EUR | 300 602 | 0,19 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | 200 482 | 0,12 | | | | | |
| 200 000 | FCA BANK IE 22-24/03/2024 FRN | EUR | 200 482 | 0,12 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | 200 417 | 0,12 | | | | | |
| 200 000 | LB BADEN-WUERT 23-28/11/2025 FRN | EUR | 200 417 | 0,12 | | | | | |
| | Obligations à taux flottants | | 19 279 270 | 11,99 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 19 279 270 | 11,99 | | | | | |
| 77 868 | CAS 2018-R07 1M2 18-25/04/2031 FRN | USD | 70 611 | 0,04 | | | | | |
| 3 405 | CAS 2019-R01 2M2 19-25/07/2031 FRN | USD | 3 095 | 0,00 | | | | | |
| 77 190 | CAS 2021-R03 1M1 21-25/12/2041 FRN | USD | 69 647 | 0,04 | | | | | |
| 455 007 | CAS 2022-R05 2M1 22-25/04/2042 FRN | USD | 414 213 | 0,26 | | | | | |
| 69 395 | CAS 2022-R06 1M1 22-25/05/2042 FRN | USD | 64 584 | 0,04 | | | | | |
| 260 163 | CAS 2023-R02 1M1 23-25/01/2043 FRN | USD | 241 108 | 0,15 | | | | | |
| 350 000 | CAS 2023-R04 1M2 23-25/05/2043 FRN | USD | 337 051 | 0,21 | | | | | |
| 443 920 | CAS 2023-R05 1M1 23-25/06/2043 FRN | USD | 404 714 | 0,25 | | | | | |
| 330 648 | CAS 2023-R07 2M1 23-25/09/2043 FRN | USD | 302 120 | 0,19 | | | | | |
| 479 494 | CAS 2023-R08 1M1 23-25/10/2043 FRN | USD | 435 019 | 0,27 | | | | | |
| 4 183 808 | FHR 5236 PS 22-25/06/2052 FRN | USD | 342 371 | 0,21 | | | | | |
| 529 960 | FNR 2005-95 OI 05-25/11/2035 FRN | USD | 59 096 | 0,04 | | | | | |
| 2 340 662 | FNR 2006-8 WN 06-25/03/2036 FRN | USD | 213 375 | 0,13 | | | | | |
| 1 062 103 | FNR 2006-85 TS 06-25/09/2036 FRN | USD | 94 591 | 0,06 | | | | | |
| 2 405 303 | FNR 2007-44 SB 07-25/05/2037 FRN | USD | 170 014 | 0,11 | | | | | |
| 1 989 156 | FNR 2010-142 SC 10-25/12/2040 FRN | USD | 203 624 | 0,13 | | | | | |
| 285 781 | FNR 2012-126 SJ 12-25/11/2042 FRN | USD | 22 298 | 0,01 | | | | | |
| 3 750 805 | FNR 2012-14 SQ 12-25/03/2042 FRN | USD | 360 599 | 0,22 | | | | | |
| 4 933 226 | FNR 2013-130 SC 13-25/01/2044 FRN | USD | 572 927 | 0,36 | | | | | |
| 548 815 | GNR 2003-98 SC 03-20/11/2033 FRN | USD | 22 754 | 0,01 | | | | | |
| 3 281 537 | GNR 2005-66 S 05-16/08/2035 FRN | USD | 246 119 | 0,15 | | | | | |
| 4 297 045 | GNR 2010-88 SA 10-20/07/2040 FRN | USD | 397 165 | 0,25 | | | | | |
| 1 110 201 | GNR 2013-172 SB 13-16/10/2043 FRN | USD | 126 794 | 0,08 | | | | | |
| 2 861 060 | GNR 2014-131 BS 14-16/09/2044 FRN | USD | 366 047 | 0,23 | | | | | |
| 5 648 578 | GNR 2014-36 SD 14-20/03/2044 FRN | USD | 459 393 | 0,29 | | | | | |
| 3 010 441 | GNR 2016-31 CS 16-20/07/2044 FRN | USD | 286 450 | 0,18 | | | | | |
| 271 556 | GNR 2017-18 QS 17-16/02/2047 FRN | USD | 26 473 | 0,02 | | | | | |
| 8 753 935 | GNR 2019-23 VS 19-20/02/2049 FRN | USD | 748 718 | 0,47 | | | | | |
| 369 547 | GNR 2021-116 IE 21-20/09/2050 FRN | USD | 29 995 | 0,02 | | | | | |
| 478 166 | GNR 2021-83 TI 21-20/05/2051 FRN | USD | 9 298 | 0,01 | | | | | |
| 1 564 244 | GNR 2021-96 SQ 21-20/06/2051 FRN | USD | 187 287 | 0,12 | | | | | |
| 4 516 186 | GNR 2022-103 KS 22-20/06/2052 FRN | USD | 372 939 | 0,23 | | | | | |
| 8 362 034 | GNR 2022-152 SA 22-20/09/2052 FRN | USD | 757 363 | 0,47 | | | | | |
| 4 965 621 | GNR 2022-153 SB 22-20/09/2052 FRN | USD | 435 720 | 0,27 | | | | | |
| 4 017 597 | GNR 2022-171 AS 22-20/07/2052 FRN | USD | 383 047 | 0,24 | | | | | |
| 8 042 454 | GNR 2022-197 LS 22-20/11/2052 FRN | USD | 738 247 | 0,46 | | | | | |
| 25 140 520 | GNR 2023-13 IB 23-20/01/2053 FRN | USD | 486 128 | 0,30 | | | | | |
| 9 755 407 | GNR 2023-56 SH 23-20/04/2053 FRN | USD | 701 731 | 0,44 | | | | | |
| 9 127 372 | GNR 2023-69 KS 23-20/05/2053 FRN | USD | 827 012 | 0,51 | | | | | |
| 2 851 477 | GNR 2023-69 SG 23-20/05/2053 FRN | USD | 245 150 | 0,15 | | | | | |
| 5 927 004 | GNR 2023-83 SJ 23-20/06/2053 FRN | USD | 469 535 | 0,29 | | | | | |
| 350 000 | JPMMT 2023-HE3 A1 23-25/05/2054 FRN | USD | 316 842 | 0,20 | | | | | |
| | | | | | 706 | STACR 2019-DNA4 M2 19-25/10/2049 FRN | USD | 640 | 0,00 |
| | | | | | 25 858 | STACR 2020-DNA5 M2 20-25/10/2050 FRN | USD | 23 737 | 0,01 |
| | | | | | 841 120 | STACR 2020-DNA6 M2 20-25/12/2050 FRN | USD | 767 337 | 0,48 |
| | | | | | 800 000 | STACR 2021-DNA3 M2 21-25/10/2033 FRN | USD | 726 493 | 0,45 |
| | | | | | 436 815 | STACR 2021-DNA5 M2 21-25/01/2034 FRN | USD | 397 090 | 0,25 |
| | | | | | 163 907 | STACR 2021-DNA6 M1 21-25/10/2041 FRN | USD | 147 827 | 0,09 |
| | | | | | 600 000 | STACR 2021-DNA7 M2 21-25/11/2041 FRN | USD | 536 342 | 0,33 |
| | | | | | 22 520 | STACR 2021-HQA2 M1 21-25/12/2033 FRN | USD | 20 331 | 0,01 |
| | | | | | 499 348 | STACR 2021-HQA3 M1 21-25/09/2041 FRN | USD | 447 322 | 0,28 |
| | | | | | 320 856 | STACR 2021-HQA4 M1 21-25/12/2041 FRN | USD | 286 838 | 0,18 |
| | | | | | 600 000 | STACR 2022-DNA2 M1B 22-25/02/2042 FRN | USD | 549 595 | 0,34 |
| | | | | | 329 280 | STACR 2022-DNA3 M1A 22-25/04/2042 FRN | USD | 300 795 | 0,19 |
| | | | | | 135 662 | STACR 2022-DNA4 M1A 22-25/05/2042 FRN | USD | 124 536 | 0,08 |
| | | | | | 450 000 | STACR 2022-HQA3 M1B 22-25/08/2042 FRN | USD | 421 171 | 0,26 |
| | | | | | 270 458 | STACR 2023-DNA2 M1A 23-25/04/2043 FRN | USD | 248 656 | 0,15 |
| | | | | | 1 041 679 | STACR 2023-HQA2 M1A 23-25/06/2043 FRN | USD | 951 132 | 0,59 |
| | | | | | 338 380 | STACR 2023-HQA3 M1 23-25/11/2043 FRN | USD | 308 164 | 0,19 |
| | | | | | | To be Announced (« TBA ») | | 14 642 424 | 9,11 |
| | | | | | | Mortgage Backed Securities | | | |
| | | | | | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 14 642 424 | 9,11 |
| | | | | | 13 800 000 | FNCL 5,5 1/13 5,500% 13-25/06/2038 | USD | 12 545 346 | 7,81 |
| | | | | | 2 300 000 | G2SF 5,5 1/23 5,500% 23-31/12/2062 | USD | 2 097 078 | 1,30 |
| | | | | | | Autres valeurs mobilières | | 2 | 0,00 |
| | | | | | | Obligations à taux flottants | | 2 | 0,00 |
| | | | | | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 2 | 0,00 |
| | | | | | 214 383 | VENDE 1994 - 3A 11O 94 - 15/09/2024 FRN | USD | 2 | 0,00 |
| | | | | | | Instruments du marché monétaire | | 21 131 163 | 13,16 |
| | | | | | | <i>France</i> | | 12 029 436 | 7,49 |
| | | | | | 500 000 | FRENCH BTF 0,000% 23-02/05/2024 | EUR | 493 960 | 0,31 |
| | | | | | 1 150 000 | FRENCH BTF 0,000% 23-04/04/2024 | EUR | 1 139 248 | 0,71 |
| | | | | | 8 780 463 | FRENCH BTF 0,000% 23-13/03/2024 | EUR | 8 718 736 | 5,43 |
| | | | | | 1 700 000 | FRENCH BTF 0,000% 23-15/05/2024 | EUR | 1 677 492 | 1,04 |
| | | | | | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 9 101 727 | 5,67 |
| | | | | | 4 000 000 | US TREASURY BILL 0,000% 23-09/01/2024 | USD | 3 617 360 | 2,25 |
| | | | | | 6 070 700 | US TREASURY BILL 0,000% 23-16/01/2024 | USD | 5 484 367 | 3,42 |
| | | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 659 040 | 0,41 |
| | | | | | | <i>Luxembourg</i> | | 659 040 | 0,41 |
| | | | | | 0 | BNP PARIBAS FLEXI I ABS OPPORTUNITIES - X CAP | EUR | 3 | 0,00 |
| | | | | | 6,99 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ASIAN CITIES BOND - X CAP | USD | 659 037 | 0,41 |
| | | | | | | Total portefeuille-titres | | 154 533 461 | 96,05 |

BNP PARIBAS FUNDS Global Environment

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|----------------------------------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 2 207 047 052 | 98,03 | Total portefeuille-titres | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>1 054 749 974</i> | <i>46,85</i> | | | | | |
| 639 003 | AGILENT TECHNOLOGIES INC | USD | 80 424 195 | 3,57 | | | | | |
| 403 374 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 48 197 469 | 2,14 | | | | | |
| 156 133 | ANSYS INC | USD | 51 290 040 | 2,28 | | | | | |
| 223 954 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 32 857 670 | 1,46 | | | | | |
| 227 923 | AUTODESK INC | USD | 50 237 353 | 2,23 | | | | | |
| 632 178 | CARRIER GLOBAL CORP | USD | 32 877 949 | 1,46 | | | | | |
| 937 374 | COGNEX CORP | USD | 35 419 355 | 1,57 | | | | | |
| 530 013 | CROWN HOLDINGS INC | USD | 44 184 943 | 1,96 | | | | | |
| 129 054 | HUBBELL INC | USD | 38 428 219 | 1,71 | | | | | |
| 286 662 | IDEX CORP | USD | 56 341 092 | 2,50 | | | | | |
| 317 261 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES | USD | 23 254 989 | 1,03 | | | | | |
| 47 958 | METTLER - TOLEDO INTERNATIONAL | USD | 52 660 241 | 2,34 | | | | | |
| 253 501 | MICROSOFT CORP | USD | 86 295 673 | 3,84 | | | | | |
| 540 374 | REPUBLIC SERVICES INC | USD | 80 670 869 | 3,59 | | | | | |
| 403 551 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 62 272 488 | 2,77 | | | | | |
| 202 369 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 44 681 844 | 1,98 | | | | | |
| 117 742 | UNITED RENTALS INC | USD | 61 119 466 | 2,71 | | | | | |
| 472 826 | VERALTO CORP | USD | 35 209 946 | 1,56 | | | | | |
| 496 239 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 80 456 620 | 3,58 | | | | | |
| 194 167 | WATERS CORP | USD | 57 869 553 | 2,57 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>354 900 788</i> | <i>15,77</i> | | | | | |
| 727 253 | APTIV PLC | USD | 59 067 704 | 2,62 | | | | | |
| 700 581 | CRODA INTERNATIONAL PLC | GBP | 40 827 812 | 1,81 | | | | | |
| 258 655 | FERGUSON PLC | GBP | 45 026 954 | 2,00 | | | | | |
| 973 132 | HALMA PLC | GBP | 25 649 224 | 1,14 | | | | | |
| 239 649 | LINDE PLC | USD | 89 101 742 | 3,97 | | | | | |
| 884 790 | PENTAIR PLC | USD | 58 238 429 | 2,59 | | | | | |
| 305 119 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 36 988 923 | 1,64 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>211 339 115</i> | <i>9,39</i> | | | | | |
| 455 075 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 80 147 809 | 3,56 | | | | | |
| 399 843 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 72 683 461 | 3,23 | | | | | |
| 2 048 594 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 58 507 845 | 2,60 | | | | | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>103 476 036</i> | <i>4,60</i> | | | | | |
| 354 033 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 32 571 036 | 1,45 | | | | | |
| 48 470 | SIKA AG - REG | CHF | 14 269 376 | 0,63 | | | | | |
| 445 285 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 56 635 624 | 2,52 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>101 825 923</i> | <i>4,52</i> | | | | | |
| 1 439 131 | GEA GROUP AG | EUR | 54 240 847 | 2,41 | | | | | |
| 280 044 | SIEMENS AG - REG | EUR | 47 585 076 | 2,11 | | | | | |
| | <i>Japon</i> | | <i>96 140 186</i> | <i>4,27</i> | | | | | |
| 61 300 | KEYENCE CORP | JPY | 24 469 498 | 1,09 | | | | | |
| 3 057 400 | KUBOTA CORP | JPY | 41 716 475 | 1,85 | | | | | |
| 213 800 | SHIMANO INC | JPY | 29 954 213 | 1,33 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>78 582 906</i> | <i>3,49</i> | | | | | |
| 549 441 | KERRY GROUP PLC - A | EUR | 43 219 029 | 1,92 | | | | | |
| 177 688 | STERIS PLC | USD | 35 363 877 | 1,57 | | | | | |
| | <i>Taiwan</i> | | <i>75 990 794</i> | <i>3,37</i> | | | | | |
| 3 343 525 | DELTA ELECTRONICS INDUSTRIAL CO | TWD | 30 934 151 | 1,37 | | | | | |
| 1 504 000 | MEDIATEK INC | TWD | 45 056 643 | 2,00 | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>53 413 232</i> | <i>2,37</i> | | | | | |
| 905 616 | EUROFINS SCIENTIFIC | EUR | 53 413 232 | 2,37 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 70 053 594 | 88,68 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 325 000 | ADAPTHEALTH LLC 4,625% 21-01/08/2029 | USD | 228 219 | 0,29 | 150 000 | FERRELLGAS ESCRO 5,375% 21-01/04/2026 | USD | 133 572 | 0,17 |
| 175 000 | ADVANCE AUTO PAR 5,900% 23-09/03/2026 | USD | 157 726 | 0,20 | 250 000 | FERRELLGAS ESCRO 5,875% 21-01/04/2029 | USD | 214 344 | 0,27 |
| 597 000 | ADVANCED DRAINAG 6,375% 22-15/06/2030 | USD | 546 252 | 0,69 | 500 000 | FORD MOTOR CO 9,625% 20-22/04/2030 | USD | 533 670 | 0,68 |
| 800 000 | ALBERTSONS COS 3,500% 20-15/03/2029 | USD | 656 592 | 0,83 | 1 400 000 | FORD MOTOR CREDIT 5,125% 20-16/06/2025 | USD | 1 253 193 | 1,60 |
| 200 000 | AMER AXLE & MFG 6,875% 20-01/07/2028 | USD | 178 449 | 0,23 | 250 000 | FORD MOTOR CREDIT 6,800% 23-12/05/2028 | USD | 236 559 | 0,30 |
| 125 000 | AMERICAN AIRLINE 5,500% 21-20/04/2026 | USD | 112 305 | 0,14 | 400 000 | FORWARD AIR CORP 9,500% 23-15/10/2031 | USD | 352 680 | 0,45 |
| 1 050 000 | AMERICAN AIRLINE 8,500% 23-15/05/2029 | USD | 1 002 418 | 1,27 | 400 000 | FRONTIER COMM 5,000% 20-01/05/2028 | USD | 335 164 | 0,42 |
| 200 000 | ARCOSA INC 4,375% 21-15/04/2029 | USD | 167 465 | 0,21 | 375 000 | FRONTIER COMMUNI 5,875% 21-01/11/2029 | USD | 288 261 | 0,36 |
| 100 000 | ARDAGH METAL PAC 3,000% 21-01/09/2029 | EUR | 80 281 | 0,10 | 425 000 | GRAY ESCROW INC 7,000% 18-15/05/2027 | USD | 360 330 | 0,46 |
| 700 000 | ARDAGH METAL PAC 6,000% 22-15/06/2027 | USD | 628 932 | 0,80 | 850 000 | GRAY TELE INC 4,750% 20-15/10/2030 | USD | 572 812 | 0,72 |
| 450 000 | ATKORE INC 4,250% 21-01/06/2031 | USD | 366 239 | 0,46 | 50 000 | HARLEY-DAVIDSON 3,050% 22-14/02/2027 | USD | 42 055 | 0,05 |
| 425 000 | AVIS BUDGET CAR 4,750% 21-01/04/2028 | USD | 356 627 | 0,45 | 250 000 | HARLEY-DAVIDSON 6,500% 23-10/03/2028 | USD | 234 047 | 0,30 |
| 200 000 | AVIS BUDGET CAR 5,750% 19-15/07/2027 | USD | 174 807 | 0,22 | 100 000 | HERC HOLDINGS 5,500% 19-15/07/2027 | USD | 89 167 | 0,11 |
| 300 000 | AVIS BUDGET CAR 8,000% 23-15/02/2031 | USD | 271 362 | 0,34 | 650 000 | HILCORP ENERGY I 5,750% 21-01/02/2029 | USD | 570 875 | 0,72 |
| 100 000 | BLOOMIN BRANDS 5,125% 21-15/04/2029 | USD | 83 737 | 0,11 | 300 000 | HILCORP ENERGY I 6,000% 22-15/04/2030 | USD | 263 622 | 0,33 |
| 350 000 | BOYD GAMING CORP 4,750% 21-15/06/2031 | USD | 291 607 | 0,37 | 208 000 | HILLENBRAND INC 3,750% 21-01/03/2031 | USD | 163 479 | 0,21 |
| 250 000 | BOYNE USA 4,750% 21-15/05/2029 | USD | 213 461 | 0,27 | 475 000 | INGLES MKTS INC 4,000% 21-15/06/2031 | USD | 380 078 | 0,48 |
| 500 000 | CABLE ONE INC 4,000% 20-15/11/2030 | USD | 367 594 | 0,47 | 525 000 | IRON MOUNTAIN 4,500% 20-15/02/2031 | USD | 431 658 | 0,55 |
| 300 000 | CAESARS ENT 7,000% 23-15/02/2030 | USD | 277 616 | 0,35 | 100 000 | IRON MOUNTAIN 4,875% 19-15/09/2029 | USD | 85 446 | 0,11 |
| 575 000 | CAMELOT RETURN 8,750% 22-01/08/2028 | USD | 531 035 | 0,67 | 100 000 | IRON MOUNTAIN 5,000% 20-15/07/2028 | USD | 87 087 | 0,11 |
| 100 000 | CATALENT PHARMA 2,375% 20-01/03/2028 | EUR | 86 712 | 0,11 | 850 000 | IRON MOUNTAIN 7,000% 23-15/02/2029 | USD | 787 834 | 1,00 |
| 100 000 | CCO HOLDINGS LLC 4,500% 21-01/05/2032 | USD | 77 445 | 0,10 | 250 000 | JACOBS ENTERTAIN 6,750% 22-15/02/2029 | USD | 213 897 | 0,27 |
| 150 000 | CCO HOLDINGS LLC 4,750% 19-01/03/2030 | USD | 124 035 | 0,16 | 325 000 | JELD-WEN INC 4,875% 17-15/12/2027 | USD | 282 141 | 0,36 |
| 1 075 000 | CCO HOLDINGS LLC 6,375% 22-01/09/2029 | USD | 958 765 | 1,21 | 575 000 | KNIFE RIVER HLD 7,750% 23-01/05/2031 | USD | 553 815 | 0,70 |
| 150 000 | CF INDUSTRIES IN 5,150% 14-15/03/2034 | USD | 134 672 | 0,17 | 250 000 | KRONOS INTERNATIONAL INC 3,750% 17-15/09/2025 | EUR | 237 969 | 0,30 |
| 100 000 | CHS/COMMUNITY 5,250% 22-15/05/2030 | USD | 75 636 | 0,10 | 100 000 | L BRANDS INC 5,250% 18-01/02/2028 | USD | 89 585 | 0,11 |
| 575 000 | CHS/COMMUNITY 6,000% 20-15/01/2029 | USD | 466 355 | 0,59 | 100 000 | L BRANDS INC 6,625% 20-01/10/2030 | USD | 92 750 | 0,12 |
| 125 000 | CHS/COMMUNITY 8,000% 19-15/12/2027 | USD | 108 660 | 0,14 | 150 000 | L BRANDS INC 6,694% 18-15/01/2027 | USD | 138 672 | 0,18 |
| 514 000 | CLEARWATER PAPER 4,750% 20-15/08/2028 | USD | 433 345 | 0,55 | 100 000 | L BRANDS INC 7,500% 19-15/06/2029 | USD | 94 192 | 0,12 |
| 104 000 | CLEARWAY ENERGY 3,750% 21-15/01/2032 | USD | 81 238 | 0,10 | 300 000 | LIFE TIME INC 5,750% 21-15/01/2026 | USD | 268 524 | 0,34 |
| 475 000 | CLEVELAND-CLIFFS 4,875% 21-01/03/2031 | USD | 388 541 | 0,49 | 350 000 | MACYS RETAIL 5,875% 21-01/04/2029 | USD | 304 624 | 0,39 |
| 475 000 | CLEVELAND-CLIFFS 6,750% 23-15/04/2030 | USD | 435 969 | 0,55 | 600 000 | MANITOWOC CO 9,000% 19-01/04/2026 | USD | 546 864 | 0,69 |
| 775 000 | COGENT COMMUNICA 7,000% 22-15/06/2027 | USD | 709 209 | 0,90 | 200 000 | MASONITE INTERNATIONAL 5,375% 19-01/02/2028 | USD | 174 614 | 0,22 |
| 130 000 | COTY INC 3,875% 21-15/04/2026 | EUR | 129 283 | 0,16 | 300 000 | MATCH GROUP INC 5,625% 19-15/02/2029 | USD | 265 220 | 0,34 |
| 200 000 | COTY INC 5,750% 23-15/09/2028 | EUR | 210 000 | 0,27 | 900 000 | MATTHEWS INTERNA 5,250% 17-01/12/2025 | USD | 799 908 | 1,01 |
| 400 000 | CRESTWOOD MID PA 5,625% 19-01/05/2027 | USD | 361 146 | 0,46 | 300 000 | MAUSER PACKAGING 7,875% 23-15/08/2026 | USD | 275 688 | 0,35 |
| 700 000 | CRESTWOOD MID PA 7,375% 23-01/02/2031 | USD | 666 263 | 0,84 | 150 000 | MIDCONTINENT COM 5,375% 19-15/08/2027 | USD | 131 917 | 0,17 |
| 318 000 | CROCS INC 4,250% 21-15/03/2029 | USD | 257 935 | 0,33 | 250 000 | MOSS CREEK RES 10,500% 19-15/05/2027 | USD | 231 932 | 0,29 |
| 400 000 | CSC HOLDINGS LLC 11,250% 23-15/05/2028 | USD | 373 262 | 0,47 | 425 000 | MOSS CREEK RES 7,500% 18-15/01/2026 | USD | 383 516 | 0,49 |
| 125 000 | CSC HOLDINGS LLC 5,375% 18-01/02/2028 | USD | 99 998 | 0,13 | 550 000 | MOZART DEBT ME 3,875% 21-01/04/2029 | USD | 450 595 | 0,57 |
| 350 000 | CSC HOLDINGS LLC 6,500% 19-01/02/2029 | USD | 278 565 | 0,35 | 275 000 | NEPTUNE BIDCO US 9,290% 22-15/04/2029 | USD | 232 144 | 0,29 |
| 675 000 | CVR PARTNERS LP 6,125% 21-15/06/2028 | USD | 572 213 | 0,72 | 550 000 | NESCO HOLDINGS 5,500% 21-15/04/2029 | USD | 458 860 | 0,58 |
| | | | | | 100 000 | NEW ENTERPRISE 5,250% 21-15/07/2028 | USD | 86 365 | 0,11 |
| | | | | | 350 000 | NEXSTAR BROADC 4,750% 20-01/11/2028 | USD | 291 988 | 0,37 |
| | | | | | 175 000 | NEXSTAR ESCROW 5,625% 19-15/07/2027 | USD | 152 639 | 0,19 |
| | | | | | 300 000 | NORTONLIFELOCK 7,125% 22-30/09/2030 | USD | 283 121 | 0,36 |

BNP PARIBAS FUNDS Global High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 125 000 | NOVELIS CORP 3,250% 21-15/11/2026 | USD | 106 202 | 0,13 | | | | | |
| 150 000 | OLIN CORP 5,125% 17-15/09/2027 | USD | 131 780 | 0,17 | | | | | |
| 250 000 | OLIN CORP 5,625% 19-01/08/2029 | USD | 223 487 | 0,28 | | | | | |
| 300 000 | OPTION CARE HEAL 4,375% 21-31/10/2029 | USD | 246 719 | 0,31 | | | | | |
| 325 000 | ORGANON FIN 1 5,125% 21-30/04/2031 | USD | 252 433 | 0,32 | | | | | |
| 400 000 | OWENS-BROCKWAY 7,250% 23-15/05/2031 | USD | 366 230 | 0,46 | | | | | |
| 325 000 | PARK-OHIO INDUST 6,625% 17-15/04/2027 | USD | 274 469 | 0,35 | | | | | |
| 200 000 | PATRICK INDS INC 4,750% 21-01/05/2029 | USD | 165 512 | 0,21 | | | | | |
| 450 000 | PBF HOLDING CO 6,000% 20-15/02/2028 | USD | 397 258 | 0,50 | | | | | |
| 525 000 | PBF HOLDING CO 7,875% 23-15/09/2030 | USD | 484 192 | 0,61 | | | | | |
| 775 000 | PETSMART INC/PE 7,750% 21-15/02/2029 | USD | 678 070 | 0,86 | | | | | |
| 525 000 | PICARD MIDCO 6,500% 22-31/03/2029 | USD | 453 397 | 0,57 | | | | | |
| 425 000 | PRIME SEC/FIN 6,250% 20-15/01/2028 | USD | 382 956 | 0,48 | | | | | |
| 300 000 | PRIME SECURITY 4,875% 16-15/07/2032 | USD | 251 515 | 0,32 | | | | | |
| 50 000 | PRIMO WATER HOLD 4,375% 21-30/04/2029 | USD | 41 785 | 0,05 | | | | | |
| 150 000 | REGAL REXNORD 6,050% 23-15/02/2026 | USD | 137 282 | 0,17 | | | | | |
| 825 000 | SCIENTIFIC GAMES 6,625% 22-01/03/2030 | USD | 704 123 | 0,89 | | | | | |
| 225 000 | SCIH SALT HOLD 4,875% 21-01/05/2028 | USD | 191 735 | 0,24 | | | | | |
| 250 000 | SEALED AIR CORP 6,125% 23-01/02/2028 | USD | 228 777 | 0,29 | | | | | |
| 750 000 | SERVICE PROP 5,500% 20-15/12/2027 | USD | 620 175 | 0,78 | | | | | |
| 150 000 | SERVICE PROP 8,625% 23-15/11/2031 | USD | 141 892 | 0,18 | | | | | |
| 200 000 | SIMMONS FOODS IN 4,625% 21-01/03/2029 | USD | 156 471 | 0,20 | | | | | |
| 150 000 | SINCLAIR TELE 5,125% 16-15/02/2027 | USD | 122 710 | 0,16 | | | | | |
| 475 000 | SITIO ROY / FIN 7,875% 23-01/11/2028 | USD | 443 975 | 0,56 | | | | | |
| 92 000 | STERICYCLE INC 3,875% 20-15/01/2029 | USD | 75 941 | 0,10 | | | | | |
| 295 000 | SYNAPTICS INC 4,000% 21-15/06/2029 | USD | 240 715 | 0,30 | | | | | |
| 125 000 | TAPESTRY INC 7,000% 23-27/11/2026 | USD | 117 141 | 0,15 | | | | | |
| 125 000 | TEGNA INC 5,000% 19-15/09/2029 | USD | 103 409 | 0,13 | | | | | |
| 125 000 | TENET HEALTHCARE 4,375% 21-15/01/2030 | USD | 104 787 | 0,13 | | | | | |
| 50 000 | TENET HEALTHCARE 4,625% 20-15/06/2028 | USD | 43 159 | 0,05 | | | | | |
| 750 000 | TERRAFORM POWER 4,750% 19-15/01/2030 | USD | 633 130 | 0,80 | | | | | |
| 100 000 | TERRAFORM POWER 5,000% 17-31/01/2028 | USD | 88 349 | 0,11 | | | | | |
| 300 000 | TITAN INTL INC 7,000% 21-30/04/2028 | USD | 270 561 | 0,34 | | | | | |
| 275 000 | TOPBUILD CORP 4,125% 21-15/02/2032 | USD | 222 653 | 0,28 | | | | | |
| 375 000 | TRONOX INC 4,625% 21-15/03/2029 | USD | 300 435 | 0,38 | | | | | |
| 850 000 | UNITED AIRLINES 4,625% 21-15/04/2029 | USD | 721 621 | 0,91 | | | | | |
| 250 000 | UNIVISION COMM 7,375% 22-30/06/2030 | USD | 225 590 | 0,29 | | | | | |
| 350 000 | UNIVISION COMM 8,000% 23-15/08/2028 | USD | 326 763 | 0,41 | | | | | |
| 125 000 | US FOODS INC 4,750% 21-15/02/2029 | USD | 107 297 | 0,14 | | | | | |
| 200 000 | US FOODS INC 6,875% 23-15/09/2028 | USD | 186 032 | 0,24 | | | | | |
| 100 000 | US FOODS INC 7,250% 23-15/01/2032 | USD | 94 713 | 0,12 | | | | | |
| 475 000 | VIAMI SOLUTIONS 3,750% 21-01/10/2029 | USD | 374 298 | 0,47 | | | | | |
| 725 000 | VM CONSOLIDATED 5,500% 21-15/04/2029 | USD | 616 044 | 0,78 | | | | | |
| 625 000 | WABASH NATIONAL 4,500% 21-15/10/2028 | USD | 512 425 | 0,65 | | | | | |
| 300 000 | WALGREENS BOOTS 3,200% 20-15/04/2030 | USD | 238 962 | 0,30 | | | | | |
| 250 000 | WALGREENS BOOTS 3,450% 16-01/06/2026 | USD | 215 011 | 0,27 | | | | | |
| 200 000 | WILLIAMS SCOTSM 4,625% 20-15/08/2028 | USD | 171 559 | 0,22 | | | | | |
| 275 000 | WYNDHAM HOTELS & 4,375% 20-15/08/2028 | USD | 233 399 | 0,30 | | | | | |
| | | | | | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>6 104 874</i> | <i>7,72</i> |
| 100 000 | ALLWYN ENTERTAIN 7,250% 23-30/04/2030 | EUR | 105 000 | 0,13 | | | | | |
| 550 000 | ALLWYN ENTERTAIN 7,875% 23-30/04/2029 | USD | 512 434 | 0,65 | | | | | |
| 180 000 | BELLIS ACQUISITI 3,250% 21-16/02/2026 | GBP | 192 178 | 0,24 | | | | | |
| 328 000 | CONSTELLATION 4,875% 21-15/07/2027 | GBP | 309 558 | 0,39 | | | | | |
| 98 864 | CO-OPERATIVE GRO 11,000% 13-22/12/2025 | GBP | 119 921 | 0,15 | | | | | |
| 100 000 | CO-OPERATIVE GRO 5,125% 19-17/05/2024 | GBP | 114 734 | 0,15 | | | | | |
| 300 000 | CO-OPERATIVE WHOLESALE 7,500% 11-08/07/2026 | GBP | 340 449 | 0,43 | | | | | |
| 269 000 | GATWICK AIRPORT 4,375% 21-07/04/2026 | GBP | 296 866 | 0,38 | | | | | |
| 200 000 | HEATHROW FINANCE 3,875% 17-01/03/2027 | GBP | 212 410 | 0,27 | | | | | |
| 700 000 | INTERNATIONAL GAME TECH 6,250% 18-15/01/2027 | USD | 645 693 | 0,82 | | | | | |
| 196 000 | MAISON FINCO PLC 6,000% 21-31/10/2027 | GBP | 195 178 | 0,25 | | | | | |
| 100 000 | MARKET BIDCO FIN 5,500% 22-04/11/2027 | GBP | 101 648 | 0,13 | | | | | |
| 200 000 | MARKS & SPENCER 3,750% 20-19/05/2026 | GBP | 223 503 | 0,28 | | | | | |
| 300 000 | MARKS & SPENCER 6,000% 12-12/06/2025 | GBP | 347 499 | 0,44 | | | | | |
| 1 000 000 | NEPTUNE ENERGY 6,625% 18-15/05/2025 | USD | 901 189 | 1,14 | | | | | |
| 200 000 | RAC BOND CO 8,250% 23-06/11/2028 | GBP | 248 067 | 0,31 | | | | | |
| 200 000 | SYNTHOMER PLC 3,875% 20-01/07/2025 | EUR | 197 167 | 0,25 | | | | | |
| 215 000 | TI AUTOMOTIVE 3,750% 21-15/04/2029 | EUR | 196 029 | 0,25 | | | | | |
| 200 000 | TVL FINANCE 10,250% 23-28/04/2028 | GBP | 239 540 | 0,30 | | | | | |
| 450 000 | VICTORIA PLC 3,625% 21-24/08/2026 | EUR | 358 875 | 0,45 | | | | | |
| 250 000 | VIRGIN MEDIA SEC 4,125% 20-15/08/2030 | GBP | 246 936 | 0,31 | | | | | |
| | | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>3 111 229</i> | <i>3,94</i> |
| 150 000 | BOELS TOPHOLD 6,250% 23-15/02/2029 | EUR | 156 258 | 0,20 | | | | | |
| 269 000 | CONSTELLIUM SE 3,125% 21-15/07/2029 | EUR | 246 608 | 0,31 | | | | | |
| 200 000 | GRUPO-ANTOLIN 3,375% 18-30/04/2026 | EUR | 176 011 | 0,22 | | | | | |
| 141 000 | IPD 3 BV 8,000% 23-15/06/2028 | EUR | 150 231 | 0,19 | | | | | |
| 110 000 | OI EUROPEAN GRP 6,250% 23-15/05/2028 | EUR | 115 000 | 0,15 | | | | | |
| 100 000 | Q-PARK HOLDING 1,500% 20-01/03/2025 | EUR | 97 900 | 0,12 | | | | | |
| 211 000 | Q-PARK HOLDING 2,000% 20-01/03/2027 | EUR | 194 753 | 0,25 | | | | | |
| 300 000 | SENSATA TECH BV 5,875% 22-01/09/2030 | USD | 269 331 | 0,34 | | | | | |
| 150 000 | TEVA PHARMACEUTICAL 7,125% 20-31/01/2025 | USD | 136 394 | 0,17 | | | | | |
| 600 000 | TEVA PHARMACEUTICAL 7,875% 23-15/09/2029 | USD | 582 852 | 0,74 | | | | | |
| 750 000 | TRIVIUM PACK FIN 8,500% 19-15/08/2027 | USD | 663 106 | 0,84 | | | | | |
| 400 000 | ZIGGO BV 4,875% 19-15/01/2030 | USD | 322 785 | 0,41 | | | | | |
| | | | | | | <i>France</i> | | <i>2 828 639</i> | <i>3,59</i> |
| 150 000 | ALTICE FRANCE 4,250% 21-15/10/2029 | EUR | 118 573 | 0,15 | | | | | |
| 375 000 | ALTICE FRANCE 5,125% 21-15/07/2029 | USD | 264 111 | 0,33 | | | | | |
| 200 000 | ALTICE FRANCE 5,500% 19-15/01/2028 | USD | 149 010 | 0,19 | | | | | |
| 100 000 | BANIJAY ENTERTAI 8,125% 23-01/05/2029 | USD | 92 806 | 0,12 | | | | | |
| 300 000 | CGG SA 7,750% 21-01/04/2027 | EUR | 274 969 | 0,35 | | | | | |
| 100 000 | ELIOR PARTICIPAT 3,750% 21-15/07/2026 | EUR | 92 212 | 0,12 | | | | | |
| 200 000 | ERAMET 7,000% 23-22/05/2028 | EUR | 203 366 | 0,26 | | | | | |
| 525 000 | ILIAD HOLDING 7,000% 21-15/10/2028 | USD | 472 887 | 0,60 | | | | | |
| 150 000 | QUATRIM 5,875% 19-15/01/2024 | EUR | 125 016 | 0,16 | | | | | |
| 148 000 | REXEL SA 5,250% 23-15/09/2030 | EUR | 154 178 | 0,20 | | | | | |
| 750 000 | SPCM SA 3,375% 21-15/03/2030 | USD | 580 062 | 0,73 | | | | | |
| 300 000 | VALLOUREC SA 8,500% 21-30/06/2026 | EUR | 301 449 | 0,38 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Canada</i> | | <i>2 795 380</i> | <i>3,53</i> | 400 000 | NIDDA HEALTHCARE 7,500% 22-21/08/2026 | EUR | 410 808 | 0,52 |
| 150 000 | 1011778 BC ULC / 4,000% 20-15/10/2030 | USD | 121 248 | 0,15 | 170 000 | TECHEM VERWALTUN 2,000% 20-15/07/2025 | EUR | 166 054 | 0,21 |
| 375 000 | 1011778 BC ULC / 4,375% 19-15/01/2028 | USD | 324 332 | 0,41 | 200 000 | TUI CRUISES GMBH 6,500% 21-15/05/2026 | EUR | 197 012 | 0,25 |
| 350 000 | BOMBARDIER INC 6,000% 21-15/02/2028 | USD | 308 541 | 0,39 | | <i>Macao</i> | | <i>1 374 208</i> | <i>1,74</i> |
| 425 000 | BOMBARDIER INC 8,750% 23-15/11/2030 | USD | 413 881 | 0,52 | 500 000 | WYNN MACAU LTD 4,875% 17-01/10/2024 | USD | 447 689 | 0,57 |
| 100 000 | HUDBAY MINERALS 6,125% 20-01/04/2029 | USD | 88 396 | 0,11 | 1 050 000 | WYNN MACAU LTD 5,500% 20-15/01/2026 | USD | 926 519 | 1,17 |
| 175 000 | MERCER INTERNATIONAL INC 5,125% 21-01/02/2029 | USD | 136 321 | 0,17 | | <i>Bermudes</i> | | <i>1 032 481</i> | <i>1,32</i> |
| 300 000 | MERCER INTERNATIONAL INC 5,500% 18-15/01/2026 | USD | 261 064 | 0,33 | 1 050 000 | CARNIVAL HLD BM 10,375% 22-01/05/2028 | USD | 1 032 481 | 1,32 |
| 675 000 | METHANEX CORP 5,125% 20-15/10/2027 | USD | 597 042 | 0,76 | | <i>Iles Caïmans</i> | | <i>863 162</i> | <i>1,09</i> |
| 50 000 | NOVA CHEMICALS 4,875% 17-01/06/2024 | USD | 44 888 | 0,06 | 875 000 | SEAGATE HDD CAYM 8,500% 23-15/07/2031 | USD | 863 162 | 1,09 |
| 200 000 | PANTHER BF AGG 2 4,375% 19-15/05/2026 | EUR | 197 727 | 0,25 | | <i>Autriche</i> | | <i>774 974</i> | <i>0,98</i> |
| 350 000 | TASEKO MINES LTD 7,000% 21-15/02/2026 | USD | 301 940 | 0,38 | 229 000 | AMS-OSRAM AG 10,500% 23-30/03/2029 | EUR | 247 631 | 0,31 |
| | <i>Italie</i> | | <i>2 612 505</i> | <i>3,30</i> | 525 000 | AMS-OSRAM AG 12,250% 23-30/03/2029 | USD | 527 343 | 0,67 |
| 109 000 | ALMAVIVA 4,875% 21-30/10/2026 | EUR | 107 365 | 0,14 | | <i>Espagne</i> | | <i>725 036</i> | <i>0,93</i> |
| 127 000 | LOTTO SPA/ROMA 7,125% 23-01/06/2028 | EUR | 133 616 | 0,17 | 360 000 | GRIFOLS ESCROW 3,875% 21-15/10/2028 | EUR | 328 196 | 0,42 |
| 381 000 | NEXI 2,125% 21-30/04/2029 | EUR | 335 756 | 0,42 | 118 000 | GRIFOLS SA 3,200% 17-01/05/2025 | EUR | 115 140 | 0,15 |
| 200 000 | PIAGGIO & C 6,500% 23-05/10/2030 | EUR | 209 843 | 0,27 | 295 435 | OHL OPERACIONES 6,600% 21-31/03/2026 | EUR | 281 700 | 0,36 |
| 506 000 | TELECOM ITALIA 1,625% 21-18/01/2029 | EUR | 437 786 | 0,55 | | <i>Pologne</i> | | <i>392 998</i> | <i>0,50</i> |
| 250 000 | TELECOM ITALIA 2,375% 17-12/10/2027 | EUR | 233 024 | 0,29 | 512 000 | CANPACK SA 3,875% 21-15/11/2029 | USD | 392 998 | 0,50 |
| 375 000 | TELECOM ITALIA 6,875% 23-15/02/2028 | EUR | 398 664 | 0,50 | | <i>Suède</i> | | <i>382 918</i> | <i>0,49</i> |
| 400 000 | TELECOM ITALIA 7,875% 23-31/07/2028 | EUR | 443 767 | 0,56 | 262 000 | VERISURE HOLDING 7,125% 23-01/02/2028 | EUR | 275 567 | 0,35 |
| 300 000 | WEBUILD SPA 7,000% 23-27/09/2028 | EUR | 312 684 | 0,40 | 100 000 | VERISURE HOLDING 9,250% 22-15/10/2027 | EUR | 107 351 | 0,14 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>1 801 736</i> | <i>2,28</i> | | <i>Ile de Jersey</i> | | <i>332 735</i> | <i>0,42</i> |
| 200 000 | ARDAGH PKG FIN 2,125% 20-15/08/2026 | EUR | 178 000 | 0,23 | 275 000 | AA BOND CO LTD 8,450% 23-31/01/2028 | GBP | 332 735 | 0,42 |
| 400 000 | ARDAGH PKG FIN 4,125% 19-15/08/2026 | USD | 330 277 | 0,42 | | <i>Portugal</i> | | <i>198 173</i> | <i>0,25</i> |
| 300 000 | ARDAGH PKG FIN 5,250% 20-30/04/2025 | USD | 263 215 | 0,33 | 200 000 | TAP SGPS SA 5,625% 19-02/12/2024 | EUR | 198 173 | 0,25 |
| 200 000 | DOLYA HOLDCO18 5,000% 20-15/07/2028 | USD | 170 650 | 0,22 | | <i>Norvège</i> | | <i>148 449</i> | <i>0,19</i> |
| 217 000 | ENERGIA GROUP 6,875% 23-31/07/2028 | EUR | 224 053 | 0,28 | 150 000 | ADEVINTA ASA 2,625% 20-15/11/2025 | EUR | 148 449 | 0,19 |
| 200 000 | JAMES HARDIE INDUSTRIES 5,000% 17-15/01/2028 | USD | 173 793 | 0,22 | | Obligations convertibles | | 374 464 | 0,47 |
| 550 000 | JAZZ SECURITIES 4,375% 21-15/01/2029 | USD | 461 748 | 0,58 | | <i>Autriche</i> | | <i>374 464</i> | <i>0,47</i> |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>1 527 642</i> | <i>1,94</i> | 400 000 | AMS AG 0,000% 18-05/03/2025 CV | EUR | 374 464 | 0,47 |
| 100 000 | B&M EUROPEAN 8,125% 23-15/11/2030 | GBP | 122 581 | 0,16 | | Obligations à taux flottant | | 4 963 231 | 6,27 |
| 100 000 | CIDRON AIDA FINC 5,000% 21-01/04/2028 | EUR | 96 130 | 0,12 | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>2 334 051</i> | <i>2,95</i> |
| 180 000 | CIRSA FINANCE IN 4,500% 21-15/03/2027 | EUR | 172 832 | 0,22 | 300 000 | ABERTIS FINANCE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 272 941 | 0,35 |
| 200 000 | CIRSA FINANCE IN 7,875% 23-31/07/2028 | EUR | 208 228 | 0,26 | 200 000 | KONINKLIJKE KPN 22-21/12/2170 FRN | EUR | 206 770 | 0,26 |
| 172 000 | CONS ENERGY FIN 5,000% 21-15/10/2028 | EUR | 139 132 | 0,18 | 300 000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 292 449 | 0,37 |
| 225 000 | CPI PROPERTY GRO 2,750% 20-12/05/2026 | EUR | 186 878 | 0,24 | 200 000 | TELEFONICA EUROP 19-31/12/2049 FRN | EUR | 198 457 | 0,25 |
| 181 000 | INTRALOT CAPITAL 5,250% 17-15/09/2024 | EUR | 115 477 | 0,15 | 200 000 | TELEFONICA EUROP 21-31/12/2061 FRN | EUR | 173 468 | 0,22 |
| 250 000 | KLEOPATRA FINCO 4,250% 21-01/03/2026 | EUR | 206 135 | 0,26 | 100 000 | TELEFONICA EUROP 22-23/11/2171 FRN | EUR | 107 976 | 0,14 |
| 265 000 | STENA INTERNATIO 7,250% 23-15/02/2028 | EUR | 280 249 | 0,35 | 100 000 | TELEFONICA EUROP 23-07/09/2172 FRN | EUR | 106 572 | 0,13 |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>1 439 872</i> | <i>1,82</i> | 100 000 | TENNET HLD BV 20-22/10/2168 FRN | EUR | 96 831 | 0,12 |
| 200 000 | CHEPLAPHARM ARZN 7,500% 23-15/05/2030 | EUR | 212 688 | 0,27 | 800 000 | WINTERSHALL FIN 21-20/01/2170 FRN | EUR | 697 167 | 0,88 |
| 200 000 | DOUGLAS GMBH 6,000% 21-08/04/2026 | EUR | 197 667 | 0,25 | 200 000 | WINTERSHALL FIN 21-20/07/2169 FRN | EUR | 181 420 | 0,23 |
| 300 000 | MAHLE GMBH 2,375% 21-14/05/2028 | EUR | 255 643 | 0,32 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Global High Yield Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|----------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>849 421</i> | <i>1,07</i> |
| 200 000 | CENTRICA PLC 15-10/04/2075 FRN | GBP | 227 188 | 0,29 |
| 200 000 | VODAFONE GROUP 18-03/10/2078 FRN | GBP | 224 125 | 0,28 |
| 200 000 | VODAFONE GROUP 23-30/08/2084 FRN | EUR | 213 695 | 0,27 |
| 150 000 | VODAFONE GROUP 23-30/08/2086 FRN | GBP | 184 413 | 0,23 |
| | <i>France</i> | | <i>715 823</i> | <i>0,90</i> |
| 200 000 | ELEC DE FRANCE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 174 968 | 0,22 |
| 400 000 | ELEC DE FRANCE 22-06/12/2171 FRN | EUR | 435 964 | 0,55 |
| 100 000 | VEOLIA ENVRNMT 23-22/02/2172 FRN | EUR | 104 891 | 0,13 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>462 066</i> | <i>0,59</i> |
| 100 000 | SES 16-29/12/2049 FRN | EUR | 99 741 | 0,13 |
| 400 000 | SES 21-31/12/2061 FRN | EUR | 362 325 | 0,46 |
| | <i>Portugal</i> | | <i>310 848</i> | <i>0,39</i> |
| 300 000 | EDP SA 23/04/2083 FRN | EUR | 310 848 | 0,39 |
| | <i>Italie</i> | | <i>170 867</i> | <i>0,22</i> |
| 200 000 | ENI SPA 21-31/12/2061 FRN | EUR | 170 867 | 0,22 |
| | <i>Norvège</i> | | <i>120 155</i> | <i>0,15</i> |
| 113 000 | VAR ENERGI ASA 23-15/11/2083 FRN | EUR | 120 155 | 0,15 |
| | Total portefeuille-titres | | 75 391 289 | 95,42 |

BNP PARIBAS FUNDS Global Inflation-Linked Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Canada</i> | | <i>8 330 895</i> | <i>1,64</i> |
| 1 780 336 | CANADA GOVERNMENT I/L 1,250% 13-01/12/2047 | CAD | 1 151 816 | 0,23 |
| 1 906 997 | CANADA GOVERNMENT I/L 1,500% 10-01/12/2044 | CAD | 1 290 364 | 0,25 |
| 2 009 220 | CANADA GOVERNMENT I/L 2,000% 07-01/12/2041 | CAD | 1 461 868 | 0,29 |
| 2 525 436 | CANADA GOVERNMENT I/L 3,000% 03-01/12/2036 | CAD | 2 061 451 | 0,41 |
| 1 180 160 | CANADA GOVERNMENT I/L 4,000% 99-01/12/2031 | CAD | 972 347 | 0,19 |
| 442 423 | CANADA GOVERNMENT I/L 4,250% 95-01/12/2026 | CAD | 329 716 | 0,06 |
| 1 943 922 | CANADA GOVERNMENT RRB 0,500% 17-01/12/2050 | CAD | 1 063 333 | 0,21 |
| | <i>Australie</i> | | <i>7 031 331</i> | <i>1,39</i> |
| 222 000 | AUSTRALIAN GOVERNMENT 0,250% 21-21/11/2032 | AUD | 141 680 | 0,03 |
| 5 575 000 | AUSTRALIAN GOVERNMENT 0,750% 17-21/11/2027 | AUD | 4 150 972 | 0,82 |
| 1 966 000 | AUSTRALIAN I/L 1,250% 15-21/08/2040 | AUD | 1 455 297 | 0,29 |
| 1 500 000 | AUSTRALIAN I/L 2,000% 13-21/08/2035 | AUD | 1 283 382 | 0,25 |
| | <i>Suède</i> | | <i>2 438 298</i> | <i>0,48</i> |
| 11 515 000 | SWEDEN I/L 0,125% 15-01/06/2032 | SEK | 1 318 637 | 0,26 |
| 10 520 000 | SWEDEN I/L 0,125% 20-01/06/2030 | SEK | 1 119 661 | 0,22 |
| | <i>Nouvelle-Zélande</i> | | <i>1 976 150</i> | <i>0,39</i> |
| 1 120 000 | NEW ZEALAND I/L 2,500% 14-20/09/2035 FLAT | NZD | 825 718 | 0,16 |
| 1 607 000 | NEW ZEALAND I/L 2,500% 17-20/09/2040 FLAT | NZD | 1 146 543 | 0,23 |
| 5 000 | NEW ZEALAND I/L 3,000% 13-20/09/2030 FLAT | NZD | 3 889 | 0,00 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>429 507</i> | <i>0,08</i> |
| 3 365 605 | DENMARK I/L GOVERNMENT 0,100% 22-15/11/2034 | DKK | 429 507 | 0,08 |
| | Obligations à taux flottant | | 4 853 607 | 0,96 |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>4 853 607</i> | <i>0,96</i> |
| 1 663 000 | UK TREASURY I/L STOCK 02-26/01/2035 FRN | GBP | 4 853 607 | 0,96 |
| | Total portefeuille-titres | | 501 687 667 | 98,79 |

BNP PARIBAS FUNDS Green Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|----------------------|-------------------|---------------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | 1 142 137 949 | 81,17 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | | | |
| 100 000 | AIR LIQUIDE SA 0,375% 21-27/05/2031 | EUR | 84 323 | 0,01 | 163 871 979 11,65 | | | | |
| 900 000 | ALD SA 4,000% 22-05/07/2027 | EUR | 917 762 | 0,07 | 1 000 000 | ABN AMRO BANK NV 0,500% 19-15/04/2026 | EUR | 945 790 | 0,07 |
| 3 900 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,100% 20-08/10/2027 | EUR | 3 490 415 | 0,25 | 100 000 | ABN AMRO BANK NV 0,875% 18-22/04/2025 | EUR | 96 680 | 0,01 |
| 1 500 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 0,250% 21-29/06/2028 | EUR | 1 320 192 | 0,09 | 12 700 000 | ABN AMRO BANK NV 5,125% 23-22/02/2028 | GBP | 14 881 454 | 1,06 |
| 100 000 | BPCE 0,125% 19-04/12/2024 | EUR | 96 926 | 0,01 | 6 929 000 | ACHMEA BV 3,625% 22-29/11/2025 | EUR | 6 952 942 | 0,49 |
| 7 200 000 | BPCE SFH 0,010% 20-27/05/2030 | EUR | 6 034 689 | 0,43 | 1 994 000 | AHOLD DELHAIZE 3,500% 23-04/04/2028 | EUR | 2 032 895 | 0,14 |
| 3 300 000 | BPCE SFH 1,750% 22-27/05/2032 | EUR | 3 025 368 | 0,21 | 7 800 000 | ALLIANDER 0,875% 16-22/04/2026 | EUR | 7 439 838 | 0,53 |
| 2 200 000 | BPIFRANCE 0,000% 21-25/05/2028 | EUR | 1 970 540 | 0,14 | 100 000 | ALLIANDER 0,875% 19-24/06/2032 | EUR | 85 464 | 0,01 |
| 2 300 000 | CAISSE FR DE FIN 3,625% 23-17/01/2029 | EUR | 2 392 019 | 0,17 | 3 509 000 | ALLIANDER 2,625% 22-09/09/2027 | EUR | 3 489 201 | 0,25 |
| 2 500 000 | CAISSE FR DE FINANCEMENT 0,100% 19-13/11/2029 | EUR | 2 142 576 | 0,15 | 1 545 000 | ALLIANDER 3,250% 23-13/06/2028 | EUR | 1 574 272 | 0,11 |
| 4 000 000 | CAISSE NATIONALE REASSURANCE MUTUELLE 0,750% 21-07/07/2028 | EUR | 3 539 677 | 0,25 | 2 904 000 | ASML HOLDING NV 2,250% 22-17/05/2032 | EUR | 2 804 004 | 0,20 |
| 2 200 000 | COVIVIO 4,625% 23-05/06/2032 | EUR | 2 280 814 | 0,16 | 1 000 000 | COCA-COLA HBC BV 2,750% 22-23/09/2025 | EUR | 990 216 | 0,07 |
| 1 000 000 | CREDIT AGRICOLE SA 0,375% 19-21/10/2025 | EUR | 952 439 | 0,07 | 4 400 000 | COOPERATIEVE RAB 0,250% 19-30/10/2026 | EUR | 4 098 080 | 0,29 |
| 700 000 | CREDIT AGRICOLE SA 4,375% 23-27/11/2033 | EUR | 734 625 | 0,05 | 22 700 000 | EDP FINANCE BV 1,710% 20-24/01/2028 | USD | 18 260 581 | 1,30 |
| 2 000 000 | ELEC DE FRANCE 1,000% 16-13/10/2026 | EUR | 1 892 413 | 0,13 | 100 000 | EDP FINANCE BV 1,875% 22-21/09/2029 | EUR | 93 300 | 0,01 |
| 11 400 000 | ELEC DE FRANCE 1,000% 21-29/11/2033 | EUR | 8 951 928 | 0,64 | 671 000 | EDP FINANCE BV 3,875% 22-11/03/2030 | EUR | 694 321 | 0,05 |
| 10 000 000 | ELEC DE FRANCE 3,625% 15-13/10/2025 | USD | 8 848 286 | 0,63 | 100 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1,500% 19-21/07/2025 | EUR | 97 092 | 0,01 |
| 4 800 000 | ENGIE 1,000% 21-26/10/2036 | EUR | 3 566 703 | 0,25 | 1 000 000 | ENEXIS HOLDING 0,625% 20-17/06/2032 | EUR | 829 110 | 0,06 |
| 3 300 000 | ENGIE 3,500% 22-27/09/2029 | EUR | 3 356 305 | 0,24 | 2 006 000 | ENEXIS HOLDING 3,625% 23-12/06/2034 | EUR | 2 113 189 | 0,15 |
| 3 308 000 | FAURECIA 2,375% 21-15/06/2029 | EUR | 3 009 796 | 0,21 | 400 000 | ING GROEP NV 2,500% 18-15/11/2030 | EUR | 382 551 | 0,03 |
| 51 759 672 | FRANCE O.A.T. 0,500% 21-25/06/2044 | EUR | 32 537 682 | 2,30 | 6 300 000 | LEASEPLAN CORP 0,250% 21-07/09/2026 | EUR | 5 781 664 | 0,41 |
| 24 852 466 | FRANCE O.A.T. 1,750% 17-25/06/2039 | EUR | 21 656 936 | 1,54 | 3 350 000 | LEASEPLAN CORP 1,375% 19-07/03/2024 | EUR | 3 333 255 | 0,24 |
| 6 305 014 | FRANCE O.A.T. I/L 0,100% 22-25/07/2038 | EUR | 5 910 623 | 0,42 | 8 100 000 | LEASEPLAN CORP 3,500% 20-09/04/2025 | EUR | 8 089 456 | 0,57 |
| 8 500 000 | ICADE 1,000% 22-19/01/2030 | EUR | 7 209 087 | 0,51 | 3 114 000 | MERCEDES-BENZ IN 3,500% 23-30/05/2026 | EUR | 3 145 951 | 0,22 |
| 3 100 000 | ICADE 1,500% 17-13/09/2027 | EUR | 2 882 411 | 0,20 | 4 632 000 | MONDELEZ INTERNATIONAL 0,625% 21-09/09/2032 | EUR | 3 743 161 | 0,27 |
| 7 800 000 | ILE DE FRANCE MB 0,400% 21-28/05/2031 | EUR | 6 611 818 | 0,47 | 100 000 | NED WATERSCHAPBK 1,000% 15-03/09/2025 | EUR | 96 974 | 0,01 |
| 1 000 000 | LA BANQUE POSTALE 1,375% 19-24/04/2029 | EUR | 905 214 | 0,06 | 5 000 000 | NED WATERSCHAPBK 2,375% 16-24/03/2026 | USD | 4 343 134 | 0,31 |
| 7 800 000 | LA BANQUE POSTALE 1,625% 22-12/05/2030 | EUR | 7 301 853 | 0,52 | 27 250 948 | NETHERLANDS GOVERNMENT 0,500% 19-15/01/2040 | EUR | 20 205 215 | 1,44 |
| 9 400 000 | LA POSTE SA 1,450% 18-30/11/2028 | EUR | 8 739 290 | 0,62 | 1 000 000 | NN BANK NV 0,500% 21-21/09/2028 | EUR | 881 270 | 0,06 |
| 1 100 000 | PSA BANQUE FRANC 3,875% 23-19/01/2026 | EUR | 1 107 314 | 0,08 | 9 300 000 | NN BANK NV 1,875% 22-17/05/2032 | EUR | 8 649 208 | 0,61 |
| 100 000 | R.A.T.P. 0,875% 17-25/05/2027 | EUR | 94 307 | 0,01 | 3 569 000 | STEDIN HOLDING 0,000% 21-16/11/2026 | EUR | 3 261 735 | 0,23 |
| 2 119 000 | RCI BANQUE 4,875% 23-14/06/2028 | EUR | 2 227 205 | 0,16 | 7 809 000 | STELLANTIS NV 4,375% 23-14/03/2030 | EUR | 8 237 494 | 0,59 |
| 3 100 000 | RTE RESEAU DE TR 0,750% 22-12/01/2034 | EUR | 2 479 410 | 0,18 | 2 357 000 | SWISSCOM FIN 0,375% 20-14/11/2028 | EUR | 2 100 667 | 0,15 |
| 2 700 000 | RTE RESEAU DE TR 3,500% 23-07/12/2031 | EUR | 2 784 792 | 0,20 | 362 000 | TENNET HLD BV 0,875% 19-03/06/2030 | EUR | 332 295 | 0,02 |
| 1 000 000 | SFIL SA 0,000% 20-23/11/2028 | EUR | 881 145 | 0,06 | 1 500 000 | TENNET HLD BV 1,000% 16-13/06/2026 | EUR | 1 443 563 | 0,10 |
| 7 000 000 | SNCF RESEAU 0,750% 19-25/05/2036 | EUR | 5 316 829 | 0,38 | 2 500 000 | TENNET HLD BV 1,625% 22-17/11/2026 | EUR | 2 438 403 | 0,17 |
| 3 400 000 | SNCF RESEAU 0,875% 19-22/01/2029 | EUR | 3 115 141 | 0,22 | 1 100 000 | TENNET HLD BV 2,750% 22-17/05/2042 | EUR | 1 021 605 | 0,07 |
| 2 500 000 | SNCF RESEAU 1,000% 16-09/11/2031 | EUR | 2 187 382 | 0,16 | 5 600 000 | TENNET HLD BV 4,750% 22-28/10/2042 | EUR | 6 450 324 | 0,46 |
| 1 100 000 | SNCF RESEAU 1,875% 17-30/03/2034 | EUR | 993 470 | 0,07 | 6 500 000 | VOLKSBANK NV 0,250% 21-22/06/2026 | EUR | 5 979 592 | 0,42 |
| 2 000 000 | SNCF RESEAU 2,250% 17-20/12/2047 | EUR | 1 606 006 | 0,11 | 6 300 000 | VOLKSBANK NV 4,625% 23-23/11/2027 | EUR | 6 476 033 | 0,46 |
| 12 000 000 | SOCIETE GENERALE 0,010% 21-02/12/2026 | EUR | 11 102 493 | 0,79 | <i>Allemagne</i> | | | | |
| 100 000 | SOCIETE NATIONAL 0,625% 20-17/04/2030 | EUR | 87 602 | 0,01 | 3 700 000 | BERLIN HYP AG 0,375% 22-25/01/2027 | EUR | 3 403 114 | 0,24 |
| 100 000 | SOCIETE NATIONAL 3,125% 22-02/11/2027 | EUR | 101 336 | 0,01 | 13 000 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 1,800% 23-15/08/2053 | EUR | 11 774 230 | 0,84 |
| 3 300 000 | SOCIETE PARIS 0,000% 20-25/11/2030 | EUR | 2 744 920 | 0,20 | 23 500 000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 2,300% 23-15/02/2033 | EUR | 24 132 149 | 1,71 |
| 4 000 000 | SOCIETE PARIS 0,300% 21-25/11/2031 | EUR | 3 303 331 | 0,23 | | | | | |
| 3 000 000 | SOCIETE PARIS 0,700% 20-15/10/2060 | EUR | 1 278 970 | 0,09 | | | | | |
| 500 000 | SOCIETE PARIS 1,000% 20-18/02/2070 | EUR | 220 313 | 0,02 | | | | | |
| 100 000 | SOCIETE PARIS 1,125% 18-22/10/2028 | EUR | 93 391 | 0,01 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Green Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| 1 000 000 | DAIMLER AG 0,750% 20-10/09/2030 | EUR | 866 470 | 0,06 | 3 461 000 | TERNA RETE 3,875% 23-24/07/2033 | EUR | 3 565 929 | 0,25 |
| 4 062 000 | DAIMLER AG 0,750% 21-11/03/2033 | EUR | 3 348 275 | 0,24 | 1 560 000 | TERNA SPA 0,750% 20-24/07/2032 | EUR | 1 271 271 | 0,09 |
| 5 600 000 | DEUTSCHE WOHNEN 0,500% 21-07/04/2031 | EUR | 4 591 522 | 0,33 | 2 000 000 | UNIONE DI BANCHE 1,500% 19-10/04/2024 | EUR | 1 985 219 | 0,14 |
| 2 766 000 | DZ HYP AG 3,375% 23-31/01/2028 | EUR | 2 843 542 | 0,20 | | Luxembourg | | 83 761 343 | 5,96 |
| 1 250 000 | E.ON SE 0,350% 19-28/02/2030 | EUR | 1 060 139 | 0,08 | 32 236 000 | EIB 2,375% 17-24/05/2027 | USD | 27 661 729 | 1,97 |
| 3 300 000 | E.ON SE 0,375% 20-29/09/2027 | EUR | 3 011 981 | 0,21 | 4 400 000 | EIB 0,500% 16-13/11/2037 | EUR | 3 242 350 | 0,23 |
| 1 549 000 | E.ON SE 3,875% 23-12/01/2035 | EUR | 1 608 474 | 0,11 | 4 250 000 | EIB 1,000% 19-14/11/2042 | EUR | 3 051 627 | 0,22 |
| 4 153 000 | E.ON SE 4,000% 23-29/08/2033 | EUR | 4 366 965 | 0,31 | 500 000 | EIB 1,250% 14-13/11/2026 | EUR | 486 233 | 0,03 |
| 800 000 | EUROGRID GMBH 3,279% 22-05/09/2031 | EUR | 795 102 | 0,06 | 5 947 000 | EIB 1,500% 17-15/11/2047 | EUR | 4 461 454 | 0,32 |
| 100 000 | ING-DIBA AG 0,010% 21-07/10/2028 | EUR | 88 311 | 0,01 | 1 597 000 | EIB 1,500% 22-15/06/2032 | EUR | 1 470 261 | 0,10 |
| 1 000 000 | KFW 0,000% 20-15/09/2028 | EUR | 894 640 | 0,06 | 15 200 000 | EIB 1,625% 21-13/05/2031 | USD | 11 688 053 | 0,83 |
| 100 000 | KFW 0,000% 21-15/06/2029 | EUR | 87 788 | 0,01 | 19 450 000 | EIB 3,300% 17-03/02/2028 | AUD | 11 626 515 | 0,83 |
| 10 000 000 | KFW 0,750% 20-30/09/2030 | USD | 7 340 734 | 0,52 | 22 600 000 | EIB 3,750% 23-14/02/2033 | USD | 20 073 121 | 1,43 |
| 33 100 000 | KFW 0,875% 19-15/09/2026 | GBP | 35 160 532 | 2,49 | | Espagne | | 82 947 303 | 5,92 |
| 6 835 000 | KFW 1,375% 22-07/06/2032 | EUR | 6 254 382 | 0,44 | 4 600 000 | ADIF ALTA VELOCI 0,550% 21-31/10/2031 | EUR | 3 747 482 | 0,27 |
| 1 000 000 | KFW 3,250% 23-24/03/2031 | EUR | 1 051 889 | 0,07 | 1 000 000 | ADIF ALTA VELOCI 0,950% 19-30/04/2027 | EUR | 939 472 | 0,07 |
| 500 000 | NRW BANK 0,500% 17-13/09/2027 | EUR | 464 962 | 0,03 | 678 000 | AUTONOMOUS COMMU 0,160% 21-30/07/2028 | EUR | 602 194 | 0,04 |
| 100 000 | NRW BANK 0,875% 15-10/11/2025 | EUR | 96 542 | 0,01 | 500 000 | AUTONOMOUS COMMU 2,822% 22-31/10/2029 | EUR | 498 975 | 0,04 |
| 700 000 | UNICREDIT 2,625% 22-27/04/2028 | EUR | 698 999 | 0,05 | 2 200 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1,000% 19-21/06/2026 | EUR | 2 087 841 | 0,15 |
| 2 100 000 | VONOVIA SE 0,625% 21-24/03/2031 | EUR | 1 651 978 | 0,12 | 5 900 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 4,375% 22-14/10/2029 | EUR | 6 263 564 | 0,45 |
| 1 700 000 | VONOVIA SE 2,375% 22-25/03/2032 | EUR | 1 487 704 | 0,11 | 1 000 000 | BANCO SANTANDER 0,300% 19-04/10/2026 | EUR | 928 694 | 0,07 |
| 4 100 000 | VONOVIA SE 5,000% 22-23/11/2030 | EUR | 4 326 874 | 0,31 | 6 200 000 | CAJA RURAL NAV 0,750% 22-16/02/2029 | EUR | 5 578 498 | 0,40 |
| | Belgique | | 101 718 835 | 7,25 | 3 300 000 | CAJA RURAL NAV 3,000% 23-26/04/2027 | EUR | 3 303 479 | 0,23 |
| 4 000 000 | BELFIUS BANK SA 0,375% 21-08/06/2027 | EUR | 3 614 257 | 0,26 | 6 321 000 | COMUNIDAD MADRID 0,827% 20-30/07/2027 | EUR | 5 906 854 | 0,42 |
| 6 000 000 | BELFIUS BANK SA 3,875% 23-12/06/2028 | EUR | 6 137 933 | 0,44 | 500 000 | IBERDROLA FIN SA 0,875% 20-16/06/2025 | EUR | 481 966 | 0,03 |
| 25 000 000 | BELGIUM GOVERNMENT 1,250% 18-22/04/2033 | EUR | 22 345 375 | 1,59 | 100 000 | IBERDROLA FIN SA 1,000% 16-07/03/2024 | EUR | 99 439 | 0,01 |
| 14 156 548 | BELGIUM GOVERNMENT 2,750% 22-22/04/2039 | EUR | 13 805 041 | 0,98 | 600 000 | IBERDROLA FIN SA 1,250% 18-28/10/2026 | EUR | 575 400 | 0,04 |
| 1 600 000 | ELIA TRANS BE 3,625% 23-18/01/2033 | EUR | 1 650 217 | 0,12 | 1 200 000 | IBERDROLA FIN SA 1,375% 22-11/03/2032 | EUR | 1 063 454 | 0,08 |
| 38 883 882 | EUROPEAN UNION 0,400% 21-04/02/2037 | EUR | 28 786 355 | 2,05 | 5 900 000 | IBERDROLA FIN SA 3,625% 23-13/07/2033 | EUR | 6 108 129 | 0,43 |
| 12 800 000 | EUROPEAN UNION 1,250% 22-04/02/2043 | EUR | 9 592 703 | 0,68 | 100 000 | INSTIT CRDT OFCL 0,000% 20-30/04/2026 | EUR | 93 743 | 0,01 |
| 2 960 000 | EUROPEAN UNION 2,625% 22-04/02/2048 | EUR | 2 756 174 | 0,20 | 100 000 | INSTIT CRDT OFCL 0,200% 19-31/01/2024 | EUR | 99 706 | 0,01 |
| 6 495 571 | EUROPEAN UNION 2,750% 22-04/02/2033 | EUR | 6 573 583 | 0,47 | 293 000 | INSTIT CRDT OFCL 3,050% 23-31/10/2027 | EUR | 296 743 | 0,02 |
| 6 500 000 | FLUVIUS 0,250% 20-02/12/2030 | EUR | 5 373 081 | 0,38 | 5 600 000 | MERLIN PROPERTIES 1,375% 21-01/06/2030 | EUR | 4 740 316 | 0,34 |
| 1 500 000 | PROXIMUS SADP 0,750% 21-17/11/2036 | EUR | 1 084 116 | 0,08 | 48 095 000 | SPANISH GOVERNMENT 1,000% 21-30/07/2042 | EUR | 32 293 387 | 2,29 |
| | Italie | | 84 419 385 | 5,97 | 100 000 | TELEFONICA EMIS 1,069% 19-05/02/2024 | EUR | 99 715 | 0,01 |
| 3 411 000 | A2A SPA 4,500% 22-19/09/2030 | EUR | 3 585 252 | 0,25 | 6 800 000 | TELEFONICA EMIS 4,183% 23-21/11/2033 | EUR | 7 138 252 | 0,51 |
| 2 890 000 | ACEA SPA 0,000% 21-28/09/2025 | EUR | 2 721 525 | 0,19 | | Etats-Unis d'Amérique | | 71 652 842 | 5,09 |
| 547 000 | ACEA SPA 0,250% 21-28/07/2030 | EUR | 449 417 | 0,03 | 19 815 000 | APPLE INC 3,000% 17-20/06/2027 | USD | 17 252 095 | 1,23 |
| 1 531 000 | ACEA SPA 3,875% 23-24/01/2031 | EUR | 1 569 624 | 0,11 | 3 481 000 | BANK OF AMERICA CORP 4,134% 23-12/06/2028 | EUR | 3 587 506 | 0,25 |
| 514 000 | ASSICURAZIONI 2,124% 19-01/10/2030 | EUR | 451 126 | 0,03 | 5 368 000 | EQUINIX INC 1,000% 21-15/03/2033 | EUR | 4 330 401 | 0,31 |
| 4 655 000 | ASSICURAZIONI 2,429% 20-14/07/2031 | EUR | 4 046 988 | 0,29 | 6 000 000 | INT BANK RECON & DEV 2,125% 15-03/03/2025 | USD | 5 277 535 | 0,37 |
| 2 505 000 | ASSICURAZIONI 5,272% 23-12/09/2033 | EUR | 2 637 739 | 0,19 | 10 000 000 | INT BANK RECON&DEV 2,900% 18-26/11/2025 | AUD | 6 031 383 | 0,43 |
| 5 439 000 | ASSICURAZIONI 5,800% 22-06/07/2032 | EUR | 5 829 324 | 0,41 | 17 945 000 | JOHNSON CONTROLS 1,750% 20-15/09/2030 | USD | 13 507 013 | 0,96 |
| 9 400 000 | CASSA DEPOSITI E 3,875% 23-13/02/2029 | EUR | 9 609 178 | 0,68 | 27 210 000 | TOYOTA MTR CREDIT 2,150% 20-13/02/2030 | USD | 21 666 909 | 1,54 |
| 7 300 000 | CREDIT AGRICOLE 0,125% 21-15/03/2033 | EUR | 5 488 856 | 0,39 | | | | | |
| 1 489 000 | FERROVIE DEL 0,375% 21-25/03/2028 | EUR | 1 321 665 | 0,09 | | | | | |
| 4 145 000 | FERROVIE DEL 3,750% 22-14/04/2027 | EUR | 4 182 062 | 0,30 | | | | | |
| 3 712 000 | FERROVIE DEL 4,125% 23-23/05/2029 | EUR | 3 812 916 | 0,27 | | | | | |
| 8 000 000 | FERROVIE DEL 4,500% 23-23/05/2033 | EUR | 8 368 322 | 0,59 | | | | | |
| 2 247 000 | INTESA SANPAOLO 0,750% 21-16/03/2028 | EUR | 2 020 460 | 0,14 | | | | | |
| 2 931 000 | INTESA SANPAOLO 4,000% 23-19/05/2026 | EUR | 2 971 834 | 0,21 | | | | | |
| 9 732 000 | ITALY BTPS 1,500% 21-30/04/2045 | EUR | 6 156 171 | 0,44 | | | | | |
| 11 451 000 | ITALY BTPS 4,000% 22-30/04/2035 | EUR | 11 658 492 | 0,83 | | | | | |
| 687 000 | ITALY BTPS 4,000% 23-30/10/2031 | EUR | 716 015 | 0,05 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Green Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Canada</i> | | <i>44 546 535</i> | <i>3,15</i> | | <i>Irlande</i> | | <i>7 538 097</i> | <i>0,54</i> |
| 51 039 000 | CANADA GOVERNMENT 2,250% 22-01/12/2029 | CAD | 33 410 537 | 2,36 | 6 130 769 | IRISH GOVERNMENT 3,000% 23-18/10/2043 | EUR | 6 329 549 | 0,45 |
| 2 880 000 | CDP FINANCIAL 1,000% 21-26/05/2026 | USD | 2 407 753 | 0,17 | 1 417 000 | SMURFIT KAPPA 0,500% 21-22/09/2029 | EUR | 1 208 548 | 0,09 |
| 12 000 000 | CPIB CAPITAL 3,000% 18-15/06/2028 | CAD | 8 054 467 | 0,57 | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>4 801 567</i> | <i>0,35</i> |
| 1 000 000 | ONTARIO PROVINCE 2,650% 18-05/02/2025 | CAD | 673 778 | 0,05 | 2 942 000 | DS SMITH PLC 4,375% 23-27/07/2027 | EUR | 3 026 166 | 0,22 |
| | <i>Chili</i> | | <i>29 653 345</i> | <i>2,11</i> | 1 000 000 | SSE PLC 0,875% 17-06/09/2025 | EUR | 959 955 | 0,07 |
| 4 500 000 | CHILE 2,550% 20-27/01/2032 | USD | 3 494 410 | 0,25 | 825 000 | SSE PLC 2,875% 22-01/08/2029 | EUR | 815 446 | 0,06 |
| 38 100 000 | CHILE 3,500% 19-25/01/2050 | USD | 26 158 935 | 1,86 | | Obligations à taux flottant | | 187 370 291 | 13,30 |
| | <i>Suède</i> | | <i>28 411 201</i> | <i>2,02</i> | | <i>Pays-Bas</i> | | <i>57 045 089</i> | <i>4,04</i> |
| 100 000 | SBAB BANK AB 0,125% 21-27/08/2026 | EUR | 92 407 | 0,01 | 5 600 000 | COOPERATIEVE RAB 21-24/02/2027 FRN | USD | 4 642 681 | 0,33 |
| 1 500 000 | SBAB BANK AB 0,500% 20-13/05/2025 | EUR | 1 438 232 | 0,10 | 5 400 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 18-31/12/2049 FRN | EUR | 5 368 862 | 0,38 |
| 1 000 000 | SBAB BANK AB 1,875% 22-10/12/2025 | EUR | 970 966 | 0,07 | 3 000 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 19-31/12/2049 FRN | EUR | 2 959 316 | 0,21 |
| 2 043 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 0,010% 20-02/12/2027 | EUR | 1 805 558 | 0,13 | 2 200 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 1 999 257 | 0,14 |
| 973 000 | SVENSKA HANDELSBANKEN 2,625% 22-05/09/2029 | EUR | 949 231 | 0,07 | 14 800 000 | ING GROEP NV 21-07/12/2028 FRN | GBP | 14 975 166 | 1,06 |
| 110 410 000 | SWEDEN KINGDOM 0,125% 20-09/09/2030 | SEK | 8 793 674 | 0,62 | 1 200 000 | ING GROEP NV 21-09/06/2032 FRN | EUR | 1 077 485 | 0,08 |
| 6 200 000 | VATTENFALL AB 0,050% 20-15/10/2025 | EUR | 5 863 904 | 0,42 | 3 800 000 | ING GROEP NV 22-23/05/2026 FRN | EUR | 3 715 814 | 0,26 |
| 4 292 000 | VATTENFALL AB 0,125% 21-12/02/2029 | EUR | 3 711 060 | 0,26 | 2 400 000 | ING GROEP NV 22-24/08/2033 FRN | EUR | 2 407 394 | 0,17 |
| 4 539 000 | VOLVO CAR AB 2,500% 20-07/10/2027 | EUR | 4 288 706 | 0,30 | 846 000 | KONINKLIJKE KPN 22-21/12/2170 FRN | EUR | 874 637 | 0,06 |
| 495 000 | VOLVO CAR AB 4,250% 22-31/05/2028 | EUR | 497 463 | 0,04 | 900 000 | TELEFONICA EUROP 22-23/11/2171 FRN | EUR | 971 781 | 0,07 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>26 682 710</i> | <i>1,89</i> | 2 600 000 | TELEFONICA EUROP 23-03/05/2171 FRN | EUR | 2 671 426 | 0,19 |
| 45 192 308 | DENMARK - BULLET 2,250% 23-15/11/2033 | DKK | 6 065 592 | 0,43 | 3 000 000 | TELEFONICA EUROP 23-07/09/2172 FRN | EUR | 3 197 160 | 0,23 |
| 3 150 000 | KOMMUNEKREDIT 0,125% 20-26/09/2040 | EUR | 2 000 303 | 0,14 | 8 200 000 | TENNET HLD BV 20-22/10/2168 FRN | EUR | 7 940 158 | 0,56 |
| 9 800 000 | ORSTED A/S 2,500% 19-16/05/2033 | GBP | 9 153 992 | 0,65 | 4 400 000 | VOLKSBANK NV 22-04/05/2027 FRN | EUR | 4 243 952 | 0,30 |
| 8 200 000 | ORSTED A/S 5,375% 22-13/09/2042 | GBP | 9 462 823 | 0,67 | | <i>France</i> | | <i>28 445 534</i> | <i>2,03</i> |
| | <i>Norvège</i> | | <i>16 709 699</i> | <i>1,18</i> | 100 000 | BNP PARIBAS 20-14/10/2027 FRN | EUR | 92 175 | 0,01 |
| 300 000 | DNB BOLIGKREDIT 0,010% 21-21/01/2031 | EUR | 246 596 | 0,02 | 4 200 000 | BNP PARIBAS 21-30/05/2028 FRN | EUR | 3 800 208 | 0,27 |
| 1 993 000 | SPAREBANK 1 OEST 0,125% 21-03/03/2028 | EUR | 1 750 015 | 0,12 | 6 200 000 | BPCE 22-14/01/2028 FRN | EUR | 5 656 090 | 0,40 |
| 3 518 000 | SPAREBANK 1 SR 2,875% 22-20/09/2025 | EUR | 3 484 362 | 0,25 | 11 000 000 | CNP ASSURANCES 19-27/07/2050 FRN | EUR | 9 528 127 | 0,68 |
| 4 192 000 | SPAREBANK 1 SR 4,875% 23-24/08/2028 | EUR | 4 411 683 | 0,31 | 1 500 000 | ENGIE 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 314 637 | 0,09 |
| 6 800 000 | SPAREBANKEN 3,125% 22-14/11/2025 | EUR | 6 817 043 | 0,48 | 1 300 000 | ENGIE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 1 070 793 | 0,08 |
| | <i>Japon</i> | | <i>15 101 279</i> | <i>1,07</i> | 1 500 000 | SOCIETE GENERALE 20-22/09/2028 FRN | EUR | 1 360 461 | 0,10 |
| 3 141 000 | JPN FIN ORG MUNI 0,010% 21-02/02/2028 | EUR | 2 812 514 | 0,20 | 5 400 000 | SOCIETE GENERALE 23-28/09/2029 FRN | EUR | 5 623 043 | 0,40 |
| 1 500 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCE 0,848% 19-19/07/2029 | EUR | 1 342 818 | 0,10 | | <i>Irlande</i> | | <i>23 229 489</i> | <i>1,65</i> |
| 3 723 000 | NIDEC CORP 0,046% 21-30/03/2026 | EUR | 3 432 162 | 0,24 | 4 840 000 | AIB GROUP PLC 21-17/11/2027 FRN | EUR | 4 438 656 | 0,32 |
| 7 982 000 | NTT FINANCE 0,082% 21-13/12/2025 | EUR | 7 513 785 | 0,53 | 2 884 000 | AIB GROUP PLC 22-04/07/2026 FRN | EUR | 2 883 374 | 0,20 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>14 844 494</i> | <i>1,06</i> | 4 149 000 | AIB GROUP PLC 22-16/02/2029 FRN | EUR | 4 457 232 | 0,32 |
| 8 664 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 1,850% 22-23/05/2049 | EUR | 7 071 475 | 0,50 | 2 222 000 | AIB GROUP PLC 23-23/10/2031 FRN | EUR | 2 398 932 | 0,17 |
| 6 800 000 | REPUBLIC OF AUSTRIA 2,900% 23-23/05/2029 | EUR | 6 988 898 | 0,50 | 3 303 000 | BANK OF IRELAND 21-10/05/2027 FRN | EUR | 3 069 943 | 0,22 |
| 1 100 000 | VERBUND AG 0,900% 21-01/04/2041 | EUR | 784 121 | 0,06 | 2 900 000 | BANK OF IRELAND 21-11/08/2031 FRN | EUR | 2 700 787 | 0,19 |
| | <i>Finlande</i> | | <i>13 441 813</i> | <i>0,96</i> | 3 075 000 | BANK OF IRELAND 23-04/07/2031 FRN | EUR | 3 280 565 | 0,23 |
| 400 000 | MUNI FINANCE PLC 0,750% 17-07/09/2027 | EUR | 376 284 | 0,03 | | <i>Espagne</i> | | <i>22 142 827</i> | <i>1,57</i> |
| 200 000 | NORDEA BANK ABP 0,500% 21-19/03/2031 | EUR | 166 750 | 0,01 | 3 400 000 | BANCO SANTANDER 21-24/06/2029 FRN | EUR | 3 007 672 | 0,21 |
| 2 401 000 | NORDEA BANK ABP 1,125% 22-16/02/2027 | EUR | 2 254 484 | 0,16 | 1 000 000 | CAIXABANK 20-18/11/2026 FRN | EUR | 941 031 | 0,07 |
| 4 000 000 | NORDIC INVESTMENT BANK 0,000% 19-25/09/2026 | EUR | 3 739 380 | 0,27 | 1 000 000 | CAIXABANK 21-09/02/2029 FRN | EUR | 880 845 | 0,06 |
| 100 000 | NORDIC INVESTMENT BANK 0,500% 18-03/11/2025 | EUR | 96 023 | 0,01 | 4 900 000 | CAIXABANK 21-18/06/2031 FRN | EUR | 4 560 266 | 0,32 |
| 5 914 000 | STORA ENSO OYJ 0,625% 20-02/12/2030 | EUR | 4 808 836 | 0,34 | 1 900 000 | CAIXABANK 22-14/11/2030 FRN | EUR | 2 048 838 | 0,15 |
| 1 979 000 | STORA ENSO OYJ 4,000% 23-01/06/2026 | EUR | 2 000 056 | 0,14 | 1 900 000 | IBERDROLA FIN SA 23-25/07/2171 FRN | EUR | 1 909 877 | 0,14 |
| | | | | | 5 300 000 | KUTXABANK 21-14/10/2027 FRN | EUR | 4 827 195 | 0,34 |
| | | | | | 3 900 000 | KUTXABANK 23-15/06/2027 FRN | EUR | 3 967 103 | 0,28 |
| | | | | | | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>18 419 377</i> | <i>1,31</i> |
| | | | | | 15 000 000 | NATWEST GROUP 21-09/11/2028 FRN | GBP | 15 434 671 | 1,10 |
| | | | | | 2 934 000 | NATWEST GROUP 22-06/09/2028 FRN | EUR | 2 984 706 | 0,21 |

BNP PARIBAS FUNDS Green Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|----------------------|-------------------|
| | <i>Allemagne</i> | | <i>9 750 266</i> | <i>0,69</i> |
| 1 800 000 | COMMERZBANK AG 20-24/03/2026 FRN | EUR | 1 727 437 | 0,12 |
| 1 500 000 | COMMERZBANK AG 23-25/03/2029 FRN | EUR | 1 574 545 | 0,11 |
| 6 500 000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG 20-26/05/2041 FRN | EUR | 5 374 399 | 0,38 |
| 1 300 000 | TALANX AG 21-01/12/2042 FRN | EUR | 1 073 885 | 0,08 |
| | <i>Italie</i> | | <i>9 490 241</i> | <i>0,67</i> |
| 4 544 000 | INTESA SANPAOLO 23-08/03/2028 FRN | EUR | 4 699 216 | 0,33 |
| 1 398 000 | TERNA RETE 22-09/02/2171 FRN | EUR | 1 248 400 | 0,09 |
| 3 397 000 | UNICREDIT SPA 23-14/02/2030 FRN | EUR | 3 542 625 | 0,25 |
| | <i>Norvège</i> | | <i>8 765 266</i> | <i>0,62</i> |
| 5 943 000 | DNB BANK ASA 22-21/09/2027 FRN | EUR | 5 919 115 | 0,42 |
| 1 735 000 | DNB BANK ASA 23-01/11/2029 FRN | EUR | 1 822 707 | 0,13 |
| 1 021 000 | DNB BANK ASA 23-16/02/2027 FRN | EUR | 1 023 444 | 0,07 |
| | <i>Portugal</i> | | <i>7 662 304</i> | <i>0,55</i> |
| 2 700 000 | CAIXA GERAL DEPO 22-31/10/2028 FRN | EUR | 2 904 842 | 0,21 |
| 600 000 | EDP SA 20-20/07/2080 FRN | EUR | 572 533 | 0,04 |
| 1 900 000 | EDP SA 21-02/08/2081 FRN | EUR | 1 764 237 | 0,13 |
| 2 700 000 | EDP SA 21-14/03/2082 FRN | EUR | 2 420 692 | 0,17 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>2 419 898</i> | <i>0,17</i> |
| 2 600 000 | KBC GROUP NV 20-16/06/2027 FRN | EUR | 2 419 898 | 0,17 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 59 930 097 | 4,25 |
| | <i>France</i> | | <i>59 930 097</i> | <i>4,25</i> |
| 2 544,58 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 59 930 097 | 4,25 |
| | Total portefeuille-titres | | 1 389 438 337 | 98,72 |

BNP PARIBAS FUNDS Green Tigers

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|-----------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | | | | | <i>Thaïlande</i> | | | | |
| | | | | | 37 837 600 | HOME PRODUCT CENTER PCL-FOR | THB | 12 860 731 | 1,46 |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | 12 860 731 | 1,46 |
| | | | | | | | | 878 451 157 | 99,51 |
| | | | | | 878 451 157 99,51 | | | | |
| Actions | | | | | | | | | |
| <i>Taiwan</i> | | | | | <i>191 897 008 21,72</i> | | | | |
| 1 868 798 | ADVANTECH CO LTD | TWD | 22 655 310 | 2,57 | | | | | |
| 679 517 | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | TWD | 22 358 993 | 2,53 | | | | | |
| 3 538 000 | CHROMA ATE INC | TWD | 24 566 227 | 2,78 | | | | | |
| 4 336 000 | DELTA ELECTRONICS INDUSTRIAL CO | TWD | 44 314 677 | 5,02 | | | | | |
| 2 243 862 | GIANT MANUFACTURING | TWD | 13 451 271 | 1,52 | | | | | |
| 2 029 102 | SINBON ELECTRONICS CO LTD | TWD | 19 771 827 | 2,24 | | | | | |
| 2 320 000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 44 778 703 | 5,06 | | | | | |
| <i>Japon</i> | | | | | <i>187 650 521 21,26</i> | | | | |
| 977 600 | DAIFUKU CO LTD | JPY | 19 809 195 | 2,24 | | | | | |
| 1 476 900 | DENSO CORP | JPY | 22 329 928 | 2,53 | | | | | |
| 218 000 | HOYA CORP | JPY | 27 296 669 | 3,09 | | | | | |
| 54 400 | KEYENCE CORP | JPY | 23 987 676 | 2,72 | | | | | |
| 887 628 | KUBOTA CORP | JPY | 13 378 611 | 1,52 | | | | | |
| 869 300 | MISUMI GROUP INC | JPY | 14 759 683 | 1,67 | | | | | |
| 1 312 200 | MURATA MANUFACTURING CO LTD | JPY | 27 894 872 | 3,16 | | | | | |
| 800 800 | SEKISUI CHEMICAL CO LTD | JPY | 11 558 698 | 1,31 | | | | | |
| 172 100 | SHIMANO INC | JPY | 26 635 189 | 3,02 | | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | <i>157 118 979 17,79</i> | | | | |
| 650 500 | BYD CO LTD-H | HKD | 17 934 949 | 2,03 | | | | | |
| 10 734 315 | CENTRE TESTING INTERNATIONAL GROUP-A | CNY | 21 495 722 | 2,44 | | | | | |
| 14 811 000 | CHINA LONGYUAN POWER GROUP - H | HKD | 11 249 694 | 1,27 | | | | | |
| 5 259 860 | GLODON SOFTWARE CO LTD - A | CNY | 12 712 936 | 1,44 | | | | | |
| 6 324 271 | JOYOUNG CO LTD - A | CNY | 11 336 490 | 1,28 | | | | | |
| 14 241 000 | KINGDEE INTERNATIONAL SFTWR | HKD | 20 815 971 | 2,36 | | | | | |
| 4 868 875 | SHENZHEN INOVANCE TECHNOLO - A | CNY | 43 379 564 | 4,91 | | | | | |
| 31 052 000 | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | HKD | 18 193 653 | 2,06 | | | | | |
| <i>Inde</i> | | | | | <i>92 840 189 10,52</i> | | | | |
| 8 305 808 | CROMPTON GREAVES CONSUMER EL | INR | 31 041 310 | 3,52 | | | | | |
| 5 350 512 | DABUR INDIA LTD | INR | 35 837 838 | 4,06 | | | | | |
| 1 426 152 | KPIT TECHNOLOGIES LTD | INR | 25 961 041 | 2,94 | | | | | |
| <i>Australie</i> | | | | | <i>86 401 853 9,79</i> | | | | |
| 2 548 692 | ALS LTD | AUD | 22 346 735 | 2,53 | | | | | |
| 297 702 | ALTIUM LTD | AUD | 9 514 544 | 1,08 | | | | | |
| 2 818 092 | BRAMBLES LTD | AUD | 26 151 629 | 2,96 | | | | | |
| 11 287 031 | CLEANAWAY WASTE MANAGEMENT L | AUD | 20 719 524 | 2,35 | | | | | |
| 149 276 | WISETECH GLOBAL LTD | AUD | 7 669 421 | 0,87 | | | | | |
| <i>Corée du Sud</i> | | | | | <i>77 984 629 8,84</i> | | | | |
| 34 360 | LG CHEM LTD | KRW | 13 308 967 | 1,51 | | | | | |
| 349 680 | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO | KRW | 41 587 244 | 4,71 | | | | | |
| 227 674 | SFA ENGINEERING CORP | KRW | 5 373 767 | 0,61 | | | | | |
| 161 326 | SK HYNIX INC | KRW | 17 714 651 | 2,01 | | | | | |
| <i>Hong-Kong</i> | | | | | <i>57 751 897 6,55</i> | | | | |
| 7 399 500 | MTR CORP | HKD | 28 751 141 | 3,26 | | | | | |
| 8 406 069 | VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS | HKD | 8 381 016 | 0,95 | | | | | |
| 18 348 000 | XINYI GLASS HOLDINGS LTD | HKD | 20 619 740 | 2,34 | | | | | |
| <i>Singapour</i> | | | | | <i>13 945 350 1,58</i> | | | | |
| 9 445 900 | KEPPEL DC REIT | SGD | 13 945 350 | 1,58 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Health Care Innovators

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|----------------------------------|-----------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 1 458 594 554 | 99,01 | Total portefeuille-titres | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | <i>Japon</i> | | | | |
| 654 589 | AGIOS PHARMACEUTICALS INC | USD | 13 196 666 | 0,90 | 1 141 000 | DAIICHI SANKYO CO LTD | JPY | 28 391 723 | 1,93 |
| 115 483 | ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | USD | 20 010 502 | 1,36 | | | | 28 391 723 | 1,93 |
| 1 002 391 | ALPHATEC HOLDINGS INC | USD | 13 711 246 | 0,93 | <i>Belgique</i> | | | | |
| 336 384 | ARCUS BIOSCIENCES INC | USD | 5 816 263 | 0,39 | 249 655 | UCB SA | EUR | 19 697 780 | 1,34 |
| 306 634 | ATRICURE INC | USD | 9 907 000 | 0,67 | | | | 19 697 780 | 1,34 |
| 356 144 | AXONICS INC | USD | 20 063 225 | 1,36 | | | | 1 458 594 554 | 99,01 |
| 129 095 | BIOGEN INC | USD | 30 241 174 | 2,05 | | | | | |
| 1 374 353 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 71 924 453 | 4,88 | | | | | |
| 269 724 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 12 528 437 | 0,85 | | | | | |
| 743 237 | CENTENE CORP | USD | 49 930 401 | 3,39 | | | | | |
| 231 215 | CEREVEL THERAPEUTICS HOLDING | USD | 8 874 771 | 0,60 | | | | | |
| 171 294 | CHARLES RIVER LABORATORIES | USD | 36 657 676 | 2,49 | | | | | |
| 189 430 | CONMED CORP | USD | 18 779 233 | 1,27 | | | | | |
| 65 620 | COOPER COS INC/THE | USD | 22 480 634 | 1,53 | | | | | |
| 436 593 | CRINETICS PHARMACEUTICALS IN | USD | 14 062 354 | 0,95 | | | | | |
| 263 533 | CYTOKINETICS INC | USD | 19 917 956 | 1,35 | | | | | |
| 187 634 | ELI LILLY & CO | USD | 99 013 816 | 6,73 | | | | | |
| 715 975 | HOLOGIC INC | USD | 46 310 065 | 3,14 | | | | | |
| 476 979 | INSMED INC | USD | 13 381 233 | 0,91 | | | | | |
| 126 063 | INTUITIVE SURGICAL INC | USD | 38 499 628 | 2,61 | | | | | |
| 339 667 | IONIS PHARMACEUTICALS INC | USD | 15 555 835 | 1,06 | | | | | |
| 79 508 | IRHYTHM TECHNOLOGIES INC | USD | 7 704 283 | 0,52 | | | | | |
| 25 798 | KARUNA THERAPEUTICS INC | USD | 7 391 776 | 0,50 | | | | | |
| 94 664 | MASIMO CORP | USD | 10 044 419 | 0,68 | | | | | |
| 481 532 | NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | USD | 57 435 981 | 3,90 | | | | | |
| 420 937 | PROCEPT BIOROBOTICS CORP | USD | 15 970 189 | 1,08 | | | | | |
| 201 536 | PTC THERAPEUTICS INC | USD | 5 028 138 | 0,34 | | | | | |
| 644 387 | PULMONX CORP | USD | 7 437 590 | 0,50 | | | | | |
| 71 176 | REGENERON PHARMACEUTICALS | USD | 56 590 928 | 3,84 | | | | | |
| 138 286 | REPLIGEN CORP | USD | 22 508 326 | 1,53 | | | | | |
| 65 636 | SHOCKWAVE MEDICAL INC | USD | 11 322 678 | 0,77 | | | | | |
| 726 482 | SPRINGWORKS THERAPEUTICS INC | USD | 24 004 520 | 1,63 | | | | | |
| 134 739 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 64 742 782 | 4,39 | | | | | |
| 82 619 | ULTRAGENYX PHARMACEUTICAL IN | USD | 3 576 554 | 0,24 | | | | | |
| 256 041 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 122 027 707 | 8,29 | | | | | |
| 584 206 | VERICEL CORP | USD | 18 832 730 | 1,28 | | | | | |
| 108 502 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 39 965 943 | 2,71 | | | | | |
| 998 714 | ZYMEWORKS INC | USD | 9 393 598 | 0,64 | | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 821 446 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 100 482 692 | 6,83 | 852 657 | SANOFI AVENTIS | EUR | 76 534 492 | 5,20 |
| 600 393 | BICYCLE THERAPEUTICS PLC-ADR | USD | 9 826 737 | 0,67 | | | | 76 534 492 | 5,20 |
| 151 042 | IMMUNOCORE HOLDINGS PLC-ADR | USD | 9 341 592 | 0,63 | | | | | |
| <i>Danemark</i> | | | | | <i>Suisse</i> | | | | |
| 106 531 | GENMAB A/S | DKK | 30 796 534 | 2,09 | 394 026 | ALCON INC | CHF | 27 819 583 | 1,89 |
| 325 499 | NOVO NORDISK A/S-B | DKK | 30 482 169 | 2,07 | 42 838 | LONZA GROUP AG - REG | CHF | 16 297 516 | 1,11 |
| <i>Irlande</i> | | | | | | | | | |
| 395 905 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | USD | 44 083 026 | 2,99 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Inclusive Growth

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 539 996 120 | 97,83 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>326 220 675</i> | <i>59,11</i> | | | | | |
| 24 822 | ADOBE INC | USD | 13 405 880 | 2,43 | | | | | |
| 47 683 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 5 697 442 | 1,03 | | | | | |
| 34 165 | BIOGEN INC | USD | 8 003 329 | 1,45 | | | | | |
| 94 580 | BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT | USD | 8 068 817 | 1,46 | | | | | |
| 96 008 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 4 459 485 | 0,81 | | | | | |
| 274 392 | COMCAST CORP - A | USD | 10 892 219 | 1,97 | | | | | |
| 30 085 | DEERE & CO | USD | 10 890 408 | 1,97 | | | | | |
| 55 894 | ECOLAB INC | USD | 10 036 278 | 1,82 | | | | | |
| 158 723 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 10 956 075 | 1,98 | | | | | |
| 16 934 | ELI LILLY & CO | USD | 8 936 013 | 1,62 | | | | | |
| 77 389 | FIRST SOLAR INC | USD | 12 069 503 | 2,19 | | | | | |
| 180 102 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GRP | USD | 13 105 145 | 2,37 | | | | | |
| 104 418 | HOLOGIC INC | USD | 6 753 873 | 1,22 | | | | | |
| 886 132 | HUNTINGTON BANCSHARES INC | USD | 10 203 774 | 1,85 | | | | | |
| 214 305 | KROGER CO | USD | 8 867 860 | 1,61 | | | | | |
| 103 996 | MERCK & CO INC | USD | 10 263 562 | 1,86 | | | | | |
| 168 850 | METLIFE INC | USD | 10 108 225 | 1,83 | | | | | |
| 120 156 | MICRON TECHNOLOGY INC | USD | 9 282 681 | 1,68 | | | | | |
| 105 980 | MICROSOFT CORP | USD | 36 077 236 | 6,55 | | | | | |
| 105 358 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 5 793 188 | 1,05 | | | | | |
| 49 978 | NVIDIA CORP | USD | 22 405 382 | 4,06 | | | | | |
| 51 034 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 13 623 234 | 2,47 | | | | | |
| 62 300 | SALESFORCE.COM INC | USD | 14 840 558 | 2,69 | | | | | |
| 22 072 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 10 519 392 | 1,91 | | | | | |
| 54 852 | VISA INC - A | USD | 12 927 822 | 2,34 | | | | | |
| 142 416 | WALT DISNEY CO | USD | 11 640 556 | 2,11 | | | | | |
| 77 295 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 12 532 055 | 2,27 | | | | | |
| 133 886 | XYLEM INC | USD | 13 860 683 | 2,51 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>52 012 356</i> | <i>9,42</i> | | | | | |
| 406 286 | AXA SA | EUR | 11 981 374 | 2,17 | | | | | |
| 109 348 | DANONE | EUR | 6 416 541 | 1,16 | | | | | |
| 153 999 | EDENRED | EUR | 8 337 506 | 1,51 | | | | | |
| 58 701 | ESSILORLUXOTTICA | EUR | 10 660 102 | 1,93 | | | | | |
| 32 435 | LOREAL | EUR | 14 616 833 | 2,65 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>51 683 006</i> | <i>9,35</i> | | | | | |
| 143 583 | APTIV PLC | USD | 11 661 854 | 2,11 | | | | | |
| 94 082 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 11 508 502 | 2,08 | | | | | |
| 541 999 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 13 422 536 | 2,43 | | | | | |
| 1 535 792 | JD SPORTS FASHION PLC | GBP | 2 941 142 | 0,53 | | | | | |
| 338 511 | RELX PLC | GBP | 12 148 972 | 2,20 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>27 318 267</i> | <i>4,95</i> | | | | | |
| 22 806 | ASML HOLDING NV | EUR | 15 546 850 | 2,82 | | | | | |
| 91 464 | WOLTERS KLUWER | EUR | 11 771 417 | 2,13 | | | | | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>24 781 907</i> | <i>4,49</i> | | | | | |
| 81 023 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 7 454 116 | 1,35 | | | | | |
| 101 569 | NESTLE SA-REG | CHF | 10 652 891 | 1,93 | | | | | |
| 25 381 | ROCHE HOLDING AG GENUSSSCHEIN | CHF | 6 674 900 | 1,21 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>21 715 491</i> | <i>3,94</i> | | | | | |
| 50 563 | ADIDAS AG | EUR | 9 311 682 | 1,69 | | | | | |
| 51 266 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 12 403 809 | 2,25 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>13 605 645</i> | <i>2,46</i> | | | | | |
| 42 830 | ACCENTURE PLC - A | USD | 13 605 645 | 2,46 | | | | | |
| | <i>Canada</i> | | <i>8 815 962</i> | <i>1,60</i> | | | | | |
| 438 570 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 8 815 962 | 1,60 | | | | | |
| | <i>Japon</i> | | <i>7 669 533</i> | <i>1,39</i> | | | | | |
| 562 100 | KUBOTA CORP | JPY | 7 669 533 | 1,39 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>6 173 278</i> | <i>1,12</i> | | | | | |
| 520 074 | IBERDROLA SA | EUR | 6 173 278 | 1,12 | | | | | |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | | | | 10 108 600 | 1,83 |
| | <i>France</i> | | | | | | | <i>10 108 600</i> | <i>1,83</i> |
| 429,39 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 10 108 600 | 1,83 | | | | | |
| | Total portefeuille-titres | | 550 104 720 | 99,66 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS India Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | 210 706 368 | 95,48 |
| | Actions | | 210 706 368 | 95,48 |
| | <i>Inde</i> | | <i>207 214 201</i> | <i>93,90</i> |
| 87 689 | ACC LTD | INR | 2 330 864 | 1,06 |
| 379 000 | AMBUJA CEMENTS LTD | INR | 2 373 740 | 1,08 |
| 1 870 471 | ASHOK LEYLAND LTD | INR | 4 081 867 | 1,85 |
| 525 000 | ASTER DM HEALTHCARE LTD | INR | 2 586 424 | 1,17 |
| 410 343 | AU SMALL FINANCE BANK LTD | INR | 3 884 044 | 1,76 |
| 730 194 | AXIS BANK LTD | INR | 9 678 435 | 4,39 |
| 1 667 982 | BANK OF INDIA | INR | 2 258 836 | 1,02 |
| 604 654 | BHARTI AIRTEL LTD | INR | 7 503 997 | 3,40 |
| 278 554 | BLUE STAR LTD | INR | 3 172 418 | 1,44 |
| 351 716 | BRIGADE ENTERPRISES LTD | INR | 3 793 771 | 1,72 |
| 300 584 | CADILA HEALTHCARE LTD | INR | 2 490 354 | 1,13 |
| 396 754 | CIE AUTOMOTIVE INDIA LTD | INR | 2 245 043 | 1,02 |
| 211 643 | CIPLA LTD | INR | 3 171 084 | 1,44 |
| 625 206 | CROMPTON GREAVES CONSUMER EL | INR | 2 336 583 | 1,06 |
| 131 596 | CUMMINS INDIA LTD | INR | 3 106 648 | 1,41 |
| 1 881 297 | EQUITAS SMALL FINANCE BANK | INR | 2 385 055 | 1,08 |
| 532 313 | FORTIS HEALTHCARE LTD | INR | 2 682 315 | 1,22 |
| 150 956 | GRASIM INDUSTRIES LTD | INR | 3 874 686 | 1,76 |
| 512 846 | GUJARAT STATE PETRONET LTD | INR | 1 886 477 | 0,85 |
| 234 699 | HCL TECHNOLOGIES LTD | INR | 4 136 420 | 1,87 |
| 581 849 | HDFC BANK LIMITED | INR | 11 943 981 | 5,41 |
| 158 730 | HINDUSTAN UNILEVER LTD | INR | 5 084 384 | 2,30 |
| 1 304 405 | ICICI BANK LTD | INR | 15 595 585 | 7,06 |
| 378 629 | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURA | INR | 2 434 202 | 1,10 |
| 444 893 | INDIAN BANK | INR | 2 251 378 | 1,02 |
| 862 380 | INDIAN HOTELS CO LTD | INR | 4 544 102 | 2,06 |
| 1 664 868 | INDIAN RENEWABLE ENERGY DEVE | INR | 2 056 733 | 0,93 |
| 175 579 | INDUSIND BANK LTD | INR | 3 374 851 | 1,53 |
| 510 024 | INFOSYS LTD | INR | 9 463 605 | 4,29 |
| 559 885 | JYOTHY LABORATORIES LTD | INR | 3 223 158 | 1,46 |
| 421 302 | MACROTECH DEVELOPERS LTD | INR | 5 186 203 | 2,35 |
| 258 972 | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | INR | 5 384 397 | 2,44 |
| 72 331 | MPHASIS LTD | INR | 2 382 192 | 1,08 |
| 566 371 | NUVOCO VISTAS CORP LTD | INR | 2 604 405 | 1,18 |
| 282 477 | PARADEEP PHOSPHATES LTD | INR | 230 391 | 0,10 |
| 274 432 | PNB HOUSING FINANCE LTD | INR | 2 575 869 | 1,17 |
| 840 232 | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | INR | 2 396 394 | 1,09 |
| 9 500 | PROCTER & GAMBLE HYGIENE | INR | 1 982 622 | 0,90 |
| 700 000 | RBL BANK LTD | INR | 2 349 828 | 1,06 |
| 1 116 197 | REDINGTON LTD | INR | 2 372 519 | 1,08 |
| 498 820 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | INR | 15 502 441 | 7,02 |
| 629 029 | STATE BANK OF INDIA | INR | 4 857 071 | 2,20 |
| 410 262 | SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES | INR | 6 211 039 | 2,81 |
| 128 059 | TATA CONSULTANCY SERVICES LTD | INR | 5 842 967 | 2,65 |
| 843 431 | TATA MOTORS LTD | INR | 5 265 642 | 2,39 |
| 169 393 | TI FINANCIAL HOLDINGS LTD | INR | 2 119 403 | 0,96 |
| 137 947 | TRENT LTD | INR | 5 066 015 | 2,30 |
| 316 189 | UJIVAN FINANCIAL SERVICES | INR | 2 148 294 | 0,97 |
| 842 806 | ZEE ENTERTAINMENT ENTERPRISE | INR | 2 785 469 | 1,26 |
| | <i>Suisse</i> | | <i>3 492 167</i> | <i>1,58</i> |
| 62 141 | ABB INDIA LTD | INR | 3 492 167 | 1,58 |
| | Total portefeuille-titres | | 210 706 368 | 95,48 |

BNP PARIBAS FUNDS Japan Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en JPY

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------------|--------------------|-----------------------|-------------------|----------------------------------|---------------------------|--------------------|-----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 26 271 322 263 | 97,54 | | | | | |
| | <i>Japon</i> | | <i>26 271 322 263</i> | <i>97,54</i> | | | | | |
| 156 800 | ABC-MART INC | JPY | 386 746 072 | 1,44 | 168 200 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | JPY | 594 223 672 | 2,21 |
| 106 400 | ADVANTEST CORP | JPY | 511 452 226 | 1,90 | 63 900 | TOKYO OHKA KOGYO CO LTD | JPY | 199 114 180 | 0,74 |
| 107 200 | AJINOMOTO CO INC | JPY | 583 970 556 | 2,17 | 101 000 | TOPPAN PRINTING CO LTD | JPY | 398 173 156 | 1,48 |
| 222 200 | AMADA HOLDINGS CO LTD | JPY | 327 377 223 | 1,22 | 529 700 | TORAY INDUSTRIES INC | JPY | 388 752 982 | 1,44 |
| 96 900 | AVEX INC | JPY | 132 669 794 | 0,49 | 305 900 | TOYOTA MOTOR CORP | JPY | 794 700 470 | 2,95 |
| 85 100 | CAPCOM CO LTD | JPY | 387 913 296 | 1,44 | 108 900 | TOYOTA TSUSHO CORP | JPY | 906 608 314 | 3,37 |
| 448 800 | CYBERAGENT INC | JPY | 397 291 551 | 1,48 | 126 200 | WEST HOLDINGS CORP | JPY | 389 356 200 | 1,45 |
| 132 600 | DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC | JPY | 397 273 171 | 1,48 | 95 600 | ZEON CORP | JPY | 125 509 674 | 0,47 |
| 236 900 | DAIICHI SANKYO CO LTD | JPY | 918 022 546 | 3,41 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 65 000 | EISAI CO LTD | JPY | 458 627 250 | 1,70 | | | | 26 271 322 263 | 97,54 |
| 248 800 | FOOD & LIFE COMPANIES LTD | JPY | 721 211 398 | 2,68 | | | | | |
| 45 700 | FUJIFILM HOLDINGS CORP | JPY | 387 559 754 | 1,44 | | | | | |
| 24 900 | FUJITSU LTD | JPY | 529 680 116 | 1,97 | | | | | |
| 198 200 | GS YUASA CORP | JPY | 394 116 560 | 1,46 | | | | | |
| 83 400 | HITACHI LTD | JPY | 849 589 538 | 3,15 | | | | | |
| 38 000 | HOSHIZAKI CORP | JPY | 196 340 731 | 0,73 | | | | | |
| 45 800 | INFO SERVICES INTERNATIONAL DENTSU | JPY | 267 599 076 | 0,99 | | | | | |
| 274 500 | INFRONEER HOLDINGS INC | JPY | 385 698 830 | 1,43 | | | | | |
| 336 400 | INPEX CORP | JPY | 640 973 571 | 2,38 | | | | | |
| 175 800 | ISUZU MOTORS LTD | JPY | 319 844 312 | 1,19 | | | | | |
| 60 500 | KATITAS CO LTD | JPY | 132 600 692 | 0,49 | | | | | |
| 59 500 | KEISEI ELECTRIC RAILWAY CO | JPY | 396 821 003 | 1,47 | | | | | |
| 47 400 | KYORITSU MAINTENANCE CO LTD | JPY | 284 108 139 | 1,05 | | | | | |
| 109 200 | LIFEDRINK CO INC | JPY | 508 991 755 | 1,89 | | | | | |
| 148 700 | LIXIL GROUP CORP | JPY | 261 887 845 | 0,97 | | | | | |
| 157 900 | MARS GROUP HOLDINGS CORP | JPY | 390 353 169 | 1,45 | | | | | |
| 34 200 | MARUZEN SHOWA UNYU CO LTD | JPY | 133 887 722 | 0,50 | | | | | |
| 125 400 | MAZDA MOTOR CORP | JPY | 191 305 807 | 0,71 | | | | | |
| 61 100 | MITSUBISHI LOGISTICS CORP | JPY | 259 998 726 | 0,97 | | | | | |
| 873 500 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP | JPY | 1 058 292 871 | 3,93 | | | | | |
| 148 100 | MORINAGA MILK INDUSTRY CO | JPY | 403 923 189 | 1,50 | | | | | |
| 114 700 | MURATA MANUFACTURING CO LTD | JPY | 343 752 003 | 1,28 | | | | | |
| 419 400 | NIKON CORP | JPY | 586 365 249 | 2,18 | | | | | |
| 59 100 | NIPPON PILLAR PACKING CO LTD | JPY | 263 587 992 | 0,98 | | | | | |
| 4 158 000 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE | JPY | 716 828 751 | 2,66 | | | | | |
| 57 800 | NIPPON YUSEN KK | JPY | 252 775 630 | 0,94 | | | | | |
| 106 800 | NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS | JPY | 396 559 429 | 1,47 | | | | | |
| 40 400 | OBIC BUSINESS CONSULTANTS | JPY | 260 874 091 | 0,97 | | | | | |
| 85 700 | ORIENTAL LAND CO LTD | JPY | 450 417 645 | 1,67 | | | | | |
| 122 000 | ORIX CORP | JPY | 324 419 575 | 1,20 | | | | | |
| 67 100 | OSAKA GAS CO LTD | JPY | 197 761 402 | 0,73 | | | | | |
| 68 700 | OSAKA SODA CO LTD | JPY | 665 872 408 | 2,47 | | | | | |
| 18 900 | POINT | JPY | 65 762 086 | 0,24 | | | | | |
| 22 300 | RECRUIT HOLDINGS CO LTD | JPY | 132 709 615 | 0,49 | | | | | |
| 261 700 | RENEAS ELECTRONICS CORP | JPY | 668 098 792 | 2,48 | | | | | |
| 554 800 | RESONA HOLDINGS INC | JPY | 397 333 729 | 1,48 | | | | | |
| 85 900 | SEKISUI HOUSE LTD | JPY | 269 328 689 | 1,00 | | | | | |
| 117 800 | SENKO CO LTD | JPY | 134 672 271 | 0,50 | | | | | |
| 268 000 | SEPTENI HOLDINGS CO LTD | JPY | 141 258 202 | 0,52 | | | | | |
| 92 300 | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD | JPY | 547 102 052 | 2,03 | | | | | |
| 63 800 | SOFTBANK GROUP CORP | JPY | 401 177 063 | 1,49 | | | | | |
| 98 900 | SONY CORP | JPY | 1 326 008 816 | 4,91 | | | | | |
| 74 000 | SUBARU CORP | JPY | 191 870 789 | 0,71 | | | | | |
| 53 100 | TAIYO YUDEN CO LTD | JPY | 198 432 328 | 0,74 | | | | | |
| 149 500 | TOKAI RIKA CO LTD | JPY | 325 786 519 | 1,21 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Japan Small Cap

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en JPY

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------------------------------|---------------------------|--------------------|-----------------------|-------------------|
| 120 000 | USEN-NEXT HOLDINGS CO LTD | JPY | 483 530 479 | 0,49 |
| 242 500 | WEST HOLDINGS CORP | JPY | 748 168 608 | 0,76 |
| 640 000 | WORLD HOLDINGS CO LTD | JPY | 1 747 801 578 | 1,79 |
| 656 000 | YAKUODO HOLDINGS CO LTD | JPY | 1 786 679 095 | 1,83 |
| 260 000 | YOKOHAMA RUBBER CO LTD | JPY | 842 323 615 | 0,86 |
| Total portefeuille-titres | | | 91 862 876 309 | 93,88 |

BNP PARIBAS FUNDS Latin America Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 47 828 820 | 98,84 | | | | | |
| <i>Brésil</i> | | | | | | | | | |
| 40 100 | AMBEV SA | BRL | 113 343 | 0,23 | | | | | |
| 66 300 | AREZZO INDUSTRIA E COMERCIO | BRL | 880 751 | 1,82 | | | | | |
| 106 200 | AZUL SA | BRL | 350 021 | 0,72 | | | | | |
| 356 300 | B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO | BRL | 1 067 227 | 2,21 | | | | | |
| 62 600 | BANCO DO BRASIL S.A. | BRL | 713 812 | 1,48 | | | | | |
| 188 580 | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES | BRL | 1 306 348 | 2,70 | | | | | |
| 54 000 | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS | BRL | 471 677 | 0,97 | | | | | |
| 58 866 | CM HOSPITALAR SA | BRL | 169 051 | 0,35 | | | | | |
| 111 768 | CPFL ENERGIA SA | BRL | 886 072 | 1,83 | | | | | |
| 77 000 | EMBRAER SA | BRL | 354 914 | 0,73 | | | | | |
| 176 044 | EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD | BRL | 1 294 526 | 2,68 | | | | | |
| 89 911 | GERDAU SA - PREF | BRL | 439 782 | 0,91 | | | | | |
| 112 010 | GPS PARTICIPACOES E EMPREEND | BRL | 434 657 | 0,90 | | | | | |
| 500 223 | ITAU UNIBANCO HOLDING S-PREF | BRL | 3 498 141 | 7,24 | | | | | |
| 122 101 | LOCALIZA RENT A CAR | BRL | 1 598 654 | 3,30 | | | | | |
| 52 600 | PETRO RIO SA | BRL | 498 647 | 1,03 | | | | | |
| 468 600 | PETROLEO BRASILEIRO PETROBRAS - PREF | BRL | 3 592 443 | 7,43 | | | | | |
| 169 100 | RAIA DROGASIL SA | BRL | 1 023 456 | 2,12 | | | | | |
| 432 400 | RAIZEN SA - PREFERENCE | BRL | 358 731 | 0,74 | | | | | |
| 56 831 | RANDON PARTICIPACOES SA-PREF | BRL | 149 752 | 0,31 | | | | | |
| 43 100 | REDE DOR SAO LUIZ SA | BRL | 255 179 | 0,53 | | | | | |
| 310 800 | RUMO SA | BRL | 1 468 391 | 3,03 | | | | | |
| 114 600 | TRACK & FIELD CO S.A | BRL | 354 586 | 0,73 | | | | | |
| 369 662 | TRES TENTOS AGROINDUSTRIAL | BRL | 916 240 | 1,89 | | | | | |
| 201 236 | VALE SA | BRL | 3 198 166 | 6,62 | | | | | |
| 27 746 | VALE SA - ADR | USD | 440 052 | 0,91 | | | | | |
| 103 742 | VIVARA PARTICIPACOES SA | BRL | 731 465 | 1,51 | | | | | |
| <i>Mexique</i> | | | | | | | | | |
| 193 378 | ALFA S.A.B.-A | MXN | 155 757 | 0,32 | | | | | |
| 94 818 | AMERICA MOVIL SAB DE CV | MXN | 88 130 | 0,18 | | | | | |
| 90 319 | AMERICA MOVIL SAB DE CV | USD | 1 672 708 | 3,46 | | | | | |
| 26 505 | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | MXN | 290 194 | 0,60 | | | | | |
| 107 759 | CEMEX SAB - ADR | USD | 835 132 | 1,73 | | | | | |
| 149 810 | CEMEX SAB - CPO | MXN | 116 950 | 0,24 | | | | | |
| 10 991 | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV | MXN | 104 474 | 0,22 | | | | | |
| 193 378 | CONTROLADORA AXTEL SAB DE CV | MXN | 2 055 | 0,00 | | | | | |
| 393 770 | CORP INMOBILIARIA VESTA SAB | MXN | 1 567 918 | 3,24 | | | | | |
| 187 140 | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA | MXN | 337 823 | 0,70 | | | | | |
| 14 526 | FOMENTO ECONOMICO MEX - ADR | USD | 1 893 464 | 3,91 | | | | | |
| 800 | FOMENTO ECONOMICO MEXICA-UBD | MXN | 10 440 | 0,02 | | | | | |
| 14 580 | GRUMA S.A.B. - B | MXN | 267 880 | 0,55 | | | | | |
| 2 845 | GRUPO AEROPORTUARIO PAC - ADR | USD | 498 501 | 1,03 | | | | | |
| 1 100 | GRUPO AEROPORTUARIO SURESTE - ADR - B | USD | 323 697 | 0,67 | | | | | |
| 72 478 | GRUPO BIMBO SAB - SERIES A | MXN | 367 857 | 0,76 | | | | | |
| 310 176 | GRUPO FINANCIERO BANORTE - O | MXN | 3 127 677 | 6,46 | | | | | |
| 8 040 | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | MXN | 117 857 | 0,24 | | | | | |
| 88 303 | KIMBERLY-CLARK DE MEXICO - A | MXN | 199 033 | 0,41 | | | | | |
| 70 900 | OPERADORA DE SITES MEX - A-1 | MXN | 100 230 | 0,21 | | | | | |
| 62 436 | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | MXN | 138 702 | 0,29 | | | | | |
| 4 486 | SITIOS LATINOAMERICA SAB DE | MXN | 1 836 | 0,00 | | | | | |
| 414 325 | WALMART DE MEXICO SAB DE CV | MXN | 1 751 055 | 3,62 | | | | | |
| | | | | | <i>Chili</i> | | | | |
| 3 439 900 | BANCO DE CHILE | CLP | 407 651 | 0,84 | | | | | |
| 24 501 700 | BANCO SANTANDER CHILE | CLP | 1 206 448 | 2,49 | | | | | |
| 204 255 | CENCOSUD SA | CLP | 387 092 | 0,80 | | | | | |
| 1 710 913 | ENEL AMERICAS SA | CLP | 191 019 | 0,39 | | | | | |
| 14 945 | QUIMICA Y MINERA CHIL - ADR | USD | 899 988 | 1,86 | | | | | |
| | | | | | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 1 000 | MERCADOLIBRE INC | USD | 1 571 540 | 3,25 | | | | | |
| | | | | | <i>Iles Caïmans</i> | | | | |
| 169 797 | BANCO BTG PACTUAL SA-UNIT | BRL | 1 314 654 | 2,72 | | | | | |
| | | | | | <i>Pérou</i> | | | | |
| 5 695 | CREDICORP LTD | USD | 853 851 | 1,76 | | | | | |
| | | | | | <i>Colombie</i> | | | | |
| 115 400 | INTERCONEXION ELECTRICA SA | COP | 461 123 | 0,95 | | | | | |
| | | | | | Obligations à taux flottant | | | | |
| | | | | | <i>Brésil</i> | | | | |
| 10 800 | VALE DO RIO DOCE 97-29/12/2049 FLAT FRN | BRL | 67 367 | 0,14 | | | | | |
| | | | | | Autres valeurs mobilières | | | | |
| | | | | | Warrants, droits | | | | |
| 438 | LOCALIZA RENT A CAR SA RTS 05/02/2024 | BRL | 1 803 | 0,00 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 47 897 990 98,98 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Multi-Asset Opportunities

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Russie</i> | | 119 799 | 0,99 |
| 115 000 | RUSSIA 12,750% 98-24/06/2028 | USD | 115 000 | 0,95 |
| 1 300 000 | RUSSIA-OFZ 7,250% 18-10/05/2034 | RUB | 4 799 | 0,04 |
| | To be Announced (« TBA ») | | 1 218 375 | 10,04 |
| | Mortgage Backed Securities | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 1 218 375 | 10,04 |
| 1 200 000 | FNCL 6 1/11 6,000% 11-25/09/2038 | USD | 1 218 375 | 10,04 |
| Autres valeurs mobilières | | | 0 | 0,00 |
| | Actions | | 0 | 0,00 |
| | <i>Russie</i> | | 0 | 0,00 |
| 50 724 | ALROSA PJSC | RUB | 0 | 0,00 |
| 106 988 | MAGNITOGORSK IRON & STEEL WORKS PJSC | RUB | 0 | 0,00 |
| 537 | POLYUS PJSC | RUB | 0 | 0,00 |
| 6 130 | VK IPJSC | USD | 0 | 0,00 |
| Instruments du marché monétaire | | | 3 265 060 | 26,90 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | 3 265 060 | 26,90 |
| 2 200 000 | FHLB DISCOUNT NT 0,000% 23-15/03/2024 | USD | 2 176 500 | 17,93 |
| 1 100 000 | US TREASURY BILL 0,000% 23-14/03/2024 | USD | 1 088 560 | 8,97 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 1 135 150 | 9,35 |
| | <i>Irlande</i> | | 575 107 | 4,74 |
| 12 424,00 | ISHARES EMERGING MARKETS LOCAL GOVERNMENT USD - USD ETF | USD | 575 107 | 4,74 |
| | <i>France</i> | | 355 715 | 2,93 |
| 5,00 | OFI PRECIOUS METALS-XL | EUR | 355 715 | 2,93 |
| | <i>Luxembourg</i> | | 204 328 | 1,68 |
| 2,00 | BNP PARIBAS FUNDS GREEN BOND - X CAP | EUR | 204 328 | 1,68 |
| Total portefeuille-titres | | | 12 665 464 | 104,38 |

BNP PARIBAS FUNDS Multi-Asset Thematic

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 4 985 079 | 3,11 |
| Obligations | | | 4 985 079 | 3,11 |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 6 742 792 | US TREASURY INFL IX N/B 0,750% 12-15/02/2042 | USD | 4 985 079 | 3,11 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 153 674 074 | 96,01 |
| <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 157,00 | AMSELECT DPAM EMERGING BOND LOCAL CCY - X CAP | USD | 15 206 193 | 9,50 |
| 56,66 | BNP PARIBAS EASY ECPI CIRCULAR ECO LEADERS - TRACK X CAP | EUR | 9 919 985 | 6,20 |
| 52,10 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL ESG BLUE ECONOMY - TRACK X DIS | EUR | 7 047 505 | 4,40 |
| 49,25 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL ESG HYDROGEN ECONOMY - TRACK X CAP | EUR | 4 670 532 | 2,92 |
| 51,81 | BNP PARIBAS EASY EUR CORP BOND SRI FOSSIL FREE - TRACK X CAP | EUR | 5 120 212 | 3,20 |
| 22 032,82 | BNP PARIBAS FUNDS AQUA - X CAP | EUR | 5 430 869 | 3,39 |
| 42 125,45 | BNP PARIBAS FUNDS DISRUPTIVE TECHNOLOGY - X CAP | EUR | 7 991 198 | 4,99 |
| 1 287,32 | BNP PARIBAS FUNDS ENERGY TRANSITION - X CAP | EUR | 1 705 587 | 1,07 |
| 65,50 | BNP PARIBAS FUNDS GLOBAL ENVIRONMENT - X DIS | EUR | 7 023 447 | 4,39 |
| 292,21 | BNP PARIBAS FUNDS GREEN BOND - X CAP | EUR | 26 930 022 | 16,82 |
| 41 595,99 | BNP PARIBAS FUNDS HEALTH CARE INNOVATORS - X CAP | EUR | 5 503 565 | 3,44 |
| 39 735,18 | BNP PARIBAS FUNDS INCLUSIVE GROWTH - X CAP | EUR | 6 550 742 | 4,09 |
| 11 576,02 | BNP PARIBAS FUNDS SMART FOOD - X CAP | EUR | 1 617 054 | 1,01 |
| 199,73 | BNP PARIBAS FUNDS SOCIAL BOND - X CAP | EUR | 19 111 939 | 11,94 |
| 70,88 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ASIAN CITIES BOND - X CAP | USD | 6 683 141 | 4,18 |
| <i>France</i> | | | | |
| 230,30 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 5 424 120 | 3,39 |
| 41,47 | OFI ENERGY STRAT MET-IEUR | EUR | 1 618 955 | 1,01 |
| 51,37 | OFI PRECIOUS METALS-XL | EUR | 3 264 936 | 2,04 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | |
| 9 862 420,00 | SEQUOIA ECONOMIC INFRASTRUCTURE INCOME FUND LIMITED - ORD NPV | GBP | 9 719 585 | 6,07 |
| <i>Irlande</i> | | | | |
| 104 257,00 | VANECK SEMICONDUCTOR ETF | EUR | 3 134 487 | 1,96 |
| Total portefeuille-titres | | | 158 659 153 | 99,12 |

BNP PARIBAS FUNDS Nordic Small Cap

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|-------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | | | | | |
| Suède | | | | | | | | | |
| 76 800 | ADDECH AB-B | SEK | 1 527 377 | 1,13 | | | | | |
| 37 927 | AF POYRY AB | SEK | 475 940 | 0,35 | | | | | |
| 125 036 | AMBEA AB | SEK | 590 783 | 0,44 | | | | | |
| 52 968 | AVANZA BANK HOLDING AB | SEK | 1 110 984 | 0,82 | | | | | |
| 47 183 | AXFOOD AB | SEK | 1 157 059 | 0,86 | | | | | |
| 34 849 | BEIJER ALMA AB | SEK | 594 773 | 0,44 | | | | | |
| 178 500 | BILLERUDKORSNAS AB | SEK | 1 641 895 | 1,21 | | | | | |
| 281 900 | BONE SUPPORT AB | SEK | 4 765 647 | 3,53 | | | | | |
| 25 000 | BUFAB HOLDING AB | SEK | 867 730 | 0,64 | | | | | |
| 9 500 | CAMURUS AB | SEK | 459 106 | 0,34 | | | | | |
| 209 219 | CASTELLUM AB | SEK | 2 693 113 | 1,99 | | | | | |
| 20 000 | CATENA AB | SEK | 846 890 | 0,63 | | | | | |
| 141 400 | CLAS OHLSON AB - B | SEK | 2 006 845 | 1,48 | | | | | |
| 186 500 | DIOS FASTIGHETER AB | SEK | 1 450 788 | 1,07 | | | | | |
| 186 747 | ELECTROLUX PROFESSIONAL AB-B | SEK | 922 622 | 0,68 | | | | | |
| 181 500 | ELEKTA AB - B | SEK | 1 342 114 | 0,99 | | | | | |
| 404 700 | FASTIGHETS AB BALDER-B | SEK | 2 599 968 | 1,92 | | | | | |
| 627 197 | GAPWAVES AB | SEK | 1 253 549 | 0,93 | | | | | |
| 43 202 | GETINGE AB - B | SEK | 870 443 | 0,64 | | | | | |
| 156 169 | GRANGES AB | SEK | 1 627 272 | 1,20 | | | | | |
| 139 744 | HANZA AB | SEK | 1 070 753 | 0,79 | | | | | |
| 124 428 | HEXATRONIC GROUP AB | SEK | 305 356 | 0,23 | | | | | |
| 138 519 | HEXPOL AB | SEK | 1 518 016 | 1,12 | | | | | |
| 7 525 | HMS NETWORKS AB | SEK | 336 217 | 0,25 | | | | | |
| 175 631 | HUSQVARNA AB - B | SEK | 1 309 127 | 0,97 | | | | | |
| 54 000 | INWIDO AB | SEK | 655 810 | 0,48 | | | | | |
| 65 612 | JOHN MATTSON FASTIGHETSFORET | SEK | 335 354 | 0,25 | | | | | |
| 78 500 | LAGERCANTZ GROUP AB - B | SEK | 952 648 | 0,70 | | | | | |
| 79 600 | LINDAB INTERNATIONAL AB | SEK | 1 423 612 | 1,05 | | | | | |
| 27 800 | LOOMIS AB | SEK | 668 249 | 0,49 | | | | | |
| 56 917 | MEKONOMEN AB | SEK | 559 328 | 0,41 | | | | | |
| 11 566 | MIPS AB | SEK | 378 694 | 0,28 | | | | | |
| 396 262 | MUNTERS GROUP AB | SEK | 5 819 791 | 4,31 | | | | | |
| 73 650 | MYCRONIC AB | SEK | 1 901 371 | 1,41 | | | | | |
| 118 837 | NCAB GROUP AB | SEK | 781 928 | 0,58 | | | | | |
| 164 350 | NCC AB - B | SEK | 1 854 243 | 1,37 | | | | | |
| 41 850 | NOTE AB | SEK | 558 251 | 0,41 | | | | | |
| 95 821 | NP3 FASTIGHETER AB | SEK | 2 005 506 | 1,48 | | | | | |
| 100 672 | NYFOSA AB | SEK | 866 778 | 0,64 | | | | | |
| 260 014 | OX2 AB | SEK | 1 281 093 | 0,95 | | | | | |
| 124 382 | PEAB AB | SEK | 637 971 | 0,47 | | | | | |
| 449 600 | SCANDIC HOTELS GROUP AB - W/I | SEK | 1 874 730 | 1,39 | | | | | |
| 18 125 | SDIPTECH AB - B | SEK | 439 266 | 0,32 | | | | | |
| 454 800 | SECURITAS AB - B | SEK | 4 027 324 | 2,99 | | | | | |
| 380 000 | SINCH AB | SEK | 1 280 377 | 0,95 | | | | | |
| 219 000 | SSAB AB - B | SEK | 1 516 328 | 1,12 | | | | | |
| 143 142 | SWEDISH ORPHAN BIOVITRUM AB | SEK | 3 433 094 | 2,54 | | | | | |
| 120 000 | TELE2 AB - B | SEK | 932 836 | 0,69 | | | | | |
| 39 199 | THULE GROUP AB/THE | SEK | 966 551 | 0,71 | | | | | |
| 347 000 | TOBII DYNAVOX AB | SEK | 1 312 257 | 0,97 | | | | | |
| 126 350 | TRELLEBORG AB - B | SEK | 3 831 642 | 2,84 | | | | | |
| 287 276 | VICORE PHARMA HOLDING AB | SEK | 365 917 | 0,27 | | | | | |
| | | | | | Norvège | | | | |
| | | | | | 31 803 001 23,53 | | | | |
| 168 046 | ATEA ASA | NOK | 1 935 334 | 1,43 | | | | | |
| 142 349 | AUSTEVOLL SEAFOOD ASA | NOK | 940 873 | 0,70 | | | | | |
| 70 844 | BONHEUR ASA | NOK | 1 528 212 | 1,13 | | | | | |
| 49 904 | BORREGAARD ASA | NOK | 762 450 | 0,56 | | | | | |
| 358 359 | ELKEM ASA | NOK | 675 926 | 0,50 | | | | | |
| 224 106 | EUROPRIAS ASA | NOK | 1 533 194 | 1,13 | | | | | |
| 417 628 | HOEGH AUTOLINERS ASA | NOK | 3 434 165 | 2,55 | | | | | |
| 97 950 | NORDIC SEMICONDUCTOR ASA | NOK | 1 100 120 | 0,81 | | | | | |
| 140 000 | PROTECTOR FORSIKRING ASA | NOK | 2 246 290 | 1,66 | | | | | |
| 88 995 | SALMAR ASA | NOK | 4 515 394 | 3,35 | | | | | |
| 19 000 | SCHIBSTED ASA - B | NOK | 468 458 | 0,35 | | | | | |
| 193 391 | SPAREBANK 1 SMN | NOK | 2 444 431 | 1,81 | | | | | |
| 153 250 | SPAREBANK 1 SR BANK ASA | NOK | 1 760 835 | 1,30 | | | | | |
| 340 200 | SPAREBANKEN VEST | NOK | 3 317 545 | 2,45 | | | | | |
| 201 101 | STOREBRAND ASA | NOK | 1 614 042 | 1,19 | | | | | |
| 327 545 | WALLENIUS WILHELMSEN ASA | NOK | 2 598 521 | 1,92 | | | | | |
| 223 217 | ZALARIS ASA | NOK | 927 211 | 0,69 | | | | | |
| | | | | | Danemark | | | | |
| | | | | | 19 001 926 14,04 | | | | |
| 26 480 | ALK-ABELLO A/S | DKK | 359 482 | 0,27 | | | | | |
| 399 700 | ALM. BRAND A/S | DKK | 639 666 | 0,47 | | | | | |
| 25 700 | FLSMIDTH & CO A/S | DKK | 990 139 | 0,73 | | | | | |
| 52 225 | ISS A/S | DKK | 903 396 | 0,67 | | | | | |
| 18 100 | JYSKE BANK - REG | DKK | 1 175 175 | 0,87 | | | | | |
| 160 700 | MATAS A/S | DKK | 2 487 713 | 1,84 | | | | | |
| 27 825 | NKT A/S | DKK | 1 731 189 | 1,28 | | | | | |
| 19 300 | NTG NORDIC TRANSPORT GROUP A | DKK | 761 173 | 0,56 | | | | | |
| 25 771 | PER AARSLEFF A/S - B | DKK | 1 114 909 | 0,82 | | | | | |
| 10 500 | SCHOUW & CO | DKK | 778 920 | 0,58 | | | | | |
| 9 340 | SOLAR A/S - B | DKK | 582 611 | 0,43 | | | | | |
| 213 000 | SPAR NORD BANK A/S | DKK | 3 045 898 | 2,25 | | | | | |
| 70 510 | SYDBANK A/S | DKK | 2 777 060 | 2,05 | | | | | |
| 33 050 | ZEALAND PHARMA A/S | DKK | 1 654 595 | 1,22 | | | | | |
| | | | | | Finlande | | | | |
| | | | | | 6 530 757 4,83 | | | | |
| 32 900 | CARGOTEC OYJ - B | EUR | 1 733 830 | 1,28 | | | | | |
| 91 900 | KEMIRA OYJ | EUR | 1 543 001 | 1,14 | | | | | |
| 102 100 | OUTOTEC OYJ | EUR | 936 257 | 0,69 | | | | | |
| 55 074 | TIETO OYJ | EUR | 1 186 294 | 0,88 | | | | | |
| 86 200 | WARTSILA OYJ ABP | EUR | 1 131 375 | 0,84 | | | | | |
| | | | | | Autres valeurs mobilières | | | | |
| | | | | | 767 823 0,57 | | | | |
| | | | | | Actions | | | | |
| | | | | | 767 823 0,57 | | | | |
| | | | | | Norvège | | | | |
| 10 441 | NOVEIDA AS | NOK | 767 823 | 0,57 | | | | | |
| | | | | | Danemark | | | | |
| 101 328 | SJAELSO GRUPPEN | DKK | 0 | 0,00 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 132 108 823 97,69 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS RMB Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | | | | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | | | | | |
| 10 000 000 | AGRICUL DEV BANK 2,250% 20-22/04/2025 | CNY | 1 409 386 | 0,77 | 10 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3,730% 20-25/05/2070 | CNY | 1 698 165 | 0,93 |
| 15 000 000 | AGRICUL DEV BANK 2,500% 23-24/03/2025 | CNY | 2 122 268 | 1,16 | 20 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3,810% 20-14/09/2050 | CNY | 3 294 478 | 1,79 |
| 15 000 000 | AGRICUL DEV BANK 2,960% 20-17/04/2030 | CNY | 2 152 418 | 1,17 | 20 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 4,000% 19-24/06/2069 | CNY | 3 592 625 | 1,96 |
| 30 000 000 | AGRICUL DEV BANK 2,990% 21-11/08/2026 | CNY | 4 293 478 | 2,34 | 15 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 4,080% 18-22/10/2048 | CNY | 2 559 991 | 1,39 |
| 30 000 000 | AGRICUL DEV BANK 3,060% 22-06/06/2032 | CNY | 4 324 877 | 2,36 | 20 000 000 | EXP - IMP BK CHINA 3,330% 16-22/02/2026 | CNY | 2 875 497 | 1,57 |
| 20 000 000 | AGRICUL DEV BANK 3,330% 16-06/01/2026 | CNY | 2 876 726 | 1,57 | 30 000 000 | EXP-IMP BK CHINA 2,820% 22-17/06/2027 | CNY | 4 282 463 | 2,33 |
| 30 000 000 | AGRICUL DEV BANK 3,520% 21-24/05/2031 | CNY | 4 464 924 | 2,43 | 30 000 000 | EXP-IMP BK CHINA 2,870% 23-06/02/2028 | CNY | 4 289 548 | 2,34 |
| 10 000 000 | AGRICUL DEV BANK 3,580% 16-22/04/2026 | CNY | 1 448 163 | 0,79 | 20 000 000 | EXP-IMP BK CHINA 3,180% 16-05/09/2026 | CNY | 2 878 711 | 1,57 |
| 30 000 000 | AGRICUL DEV BANK 3,630% 19-19/07/2026 | CNY | 4 364 254 | 2,38 | 30 000 000 | EXP-IMP BK CHINA 3,180% 22-11/03/2032 | CNY | 4 361 437 | 2,38 |
| 30 000 000 | CHINA DEV BANK 2,770% 22-24/10/2032 | CNY | 4 236 310 | 2,31 | 20 000 000 | EXP-IMP BK CHINA 3,220% 21-14/05/2026 | CNY | 2 873 215 | 1,57 |
| 40 000 000 | CHINA DEV BANK 3,000% 22-17/01/2032 | CNY | 5 742 347 | 3,13 | 35 000 000 | EXP-IMP BK CHINA 3,230% 20-23/03/2030 | CNY | 5 089 424 | 2,77 |
| 30 000 000 | CHINA DEV BANK 3,050% 16-25/08/2026 | CNY | 4 303 778 | 2,34 | 10 000 000 | EXP-IMP BK CHINA 3,870% 15-14/09/2025 | CNY | 1 445 630 | 0,79 |
| 30 000 000 | CHINA DEV BANK 3,070% 20-10/03/2030 | CNY | 4 333 071 | 2,36 | <i>Corée du Sud</i> | | | | |
| 40 000 000 | CHINA DEV BANK 3,180% 16-05/04/2026 | CNY | 5 745 782 | 3,12 | 33 000 000 | EXP-IMP BK KOREA 2,800% 21-03/03/2024 | CNY | 4 646 600 | 2,53 |
| 30 000 000 | CHINA DEV BANK 3,300% 21-03/03/2026 | CNY | 4 317 885 | 2,35 | <i>Allemagne</i> | | | | |
| 20 000 000 | CHINA DEV BANK 3,480% 19-08/01/2029 | CNY | 2 942 201 | 1,60 | 10 000 000 | KFW 2,700% 21-25/03/2024 | CNY | 1 407 455 | 0,77 |
| 5 000 000 | CHINA DEV BANK 3,490% 21-08/11/2041 | CNY | 765 341 | 0,42 | 14 000 000 | KFW 2,750% 22-03/03/2025 | CNY | 1 977 663 | 1,08 |
| 20 000 000 | CHINA DEV BANK 3,660% 21-01/03/2031 | CNY | 2 993 968 | 1,63 | <i>Philippines</i> | | | | |
| 30 000 000 | CHINA DEV BANK 3,680% 19-26/02/2026 | CNY | 4 348 959 | 2,37 | 23 000 000 | ASIAN DEV BANK 2,900% 19-05/03/2024 | CNY | 3 243 042 | 1,77 |
| 20 000 000 | CHINA DEV BANK 3,700% 20-20/10/2030 | CNY | 2 998 790 | 1,63 | <i>Hong-Kong</i> | | | | |
| 5 000 000 | CHINA DEV BANK 3,740% 15-10/09/2025 | CNY | 721 679 | 0,39 | 10 000 000 | ICBC FIN LEASE 3,950% 19-04/03/2024 | CNY | 1 413 075 | 0,77 |
| 15 000 000 | CHINA DEV BANK 3,800% 16-25/01/2036 | CNY | 2 324 594 | 1,27 | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| 10 000 000 | CHINA DEV BANK 3,900% 20-03/08/2040 | CNY | 1 596 456 | 0,87 | 2 000 000 | INT BK RECON&DEV 3,050% 22-16/03/2024 | CNY | 282 336 | 0,15 |
| 40 000 000 | CHINA DEV BANK 4,040% 17-10/04/2027 | CNY | 5 924 593 | 3,22 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 20 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,370% 22-20/01/2027 | CNY | 2 823 245 | 1,54 | 179 996 300 98,06 | | | | |
| 40 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,400% 23-15/07/2028 | CNY | 5 644 369 | 3,08 | | | | | |
| 20 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,480% 22-15/04/2027 | CNY | 2 829 550 | 1,54 | | | | | |
| 10 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,500% 22-25/07/2027 | CNY | 1 416 711 | 0,77 | | | | | |
| 10 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,620% 23-15/04/2028 | CNY | 1 424 576 | 0,78 | | | | | |
| 10 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,680% 20-21/05/2030 | CNY | 1 421 712 | 0,77 | | | | | |
| 20 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,750% 22-15/06/2029 | CNY | 2 859 538 | 1,56 | | | | | |
| 25 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,750% 22-17/02/2032 | CNY | 3 564 733 | 1,94 | | | | | |
| 20 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,800% 22-24/03/2029 | CNY | 2 866 258 | 1,56 | | | | | |
| 40 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,850% 20-04/06/2027 | CNY | 5 731 202 | 3,12 | | | | | |
| 10 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2,910% 21-14/10/2028 | CNY | 1 443 134 | 0,79 | | | | | |
| 50 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3,020% 21-27/05/2031 | CNY | 7 274 343 | 3,95 | | | | | |
| 5 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3,270% 16-22/08/2046 | CNY | 750 499 | 0,41 | | | | | |
| 15 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3,320% 22-15/04/2052 | CNY | 2 285 553 | 1,25 | | | | | |
| 20 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3,390% 20-16/03/2050 | CNY | 3 070 655 | 1,67 | | | | | |
| 10 000 000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3,720% 21-12/04/2051 | CNY | 1 626 619 | 0,89 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Russia Equity (VNI suspendue)

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | |
|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|--------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | Instruments du marché monétaire | | | | | |
| | | | 15 373 504 | 26,53 | | | | 40 786 492 | 70,36 | |
| Actions | | | | | | | | | | |
| Pays-Bas | | | | | | | | | | |
| 471 261 | VEON LTD | USD | 8 404 330 | 14,50 | | <i>Allemagne</i> | | 16 914 491 | 29,17 | |
| 675 047 | YANDEX NV - A | USD | 8 404 329 | 14,50 | 17 000 000 | GERMAN T-BILL 0,000% 23-21/02/2024 | EUR | 16 914 491 | 29,17 | |
| 92 153 | YANDEX NV - A | RUB | 0 | 0,00 | | <i>France</i> | | 11 939 281 | 20,60 | |
| | | | | | 12 000 000 | FRENCH BTF 0,000% 23-21/02/2024 | EUR | 11 939 281 | 20,60 | |
| | | | | | | <i>Pays-Bas</i> | | 11 932 720 | 20,59 | |
| | | | | | 12 000 000 | DUTCH TREASURY CERT 0,000% 23-28/02/2024 | EUR | 11 932 720 | 20,59 | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | 56 159 998 | 96,89 |
| | <i>Ukraine</i> | | 4 038 468 | 6,97 | | | | | | |
| 1 453 125 | MHP SA - GDR REGS | USD | 4 038 468 | 6,97 | | | | | | |
| | <i>Kazakhstan</i> | | 2 930 590 | 5,06 | | | | | | |
| 79 151 | NAC KAZATOMPROM JSC-GDR | USD | 2 930 590 | 5,06 | | | | | | |
| | <i>Russie</i> | | 106 | 0,00 | | | | | | |
| 4 597 144 | AEROFLOT RUSSIAN AIRLINES | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 897 339 | GAZPROM NEFT PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 13 452 511 | GAZPROM PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 660 834 | GLOBALTRUCK MANAGEMENT PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 89 592 201 | INTER RAO UES PJSC | RUB | 1 | 0,00 | | | | | | |
| 54 | LUGA ABRASIVE PLANT-BRD | USD | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 244 986 | LUKOIL PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 1 764 580 | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJ | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 160 199 | NOVATEK PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 23 676 | NOVATEK PJSC-SPONS GDR REG S | USD | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 5 800 653 | NOVOLIPETSK STEEL OAO | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 11 709 669 | RENAISSANCE INSURANCE GROUP | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 1 710 000 | ROSNEFT OIL CO PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 17 331 201 | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 113 830 389 | SEGEZHA GROUP PJSC | RUB | 1 | 0,00 | | | | | | |
| 40 768 756 | SISTEMA PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 1 173 880 | SPB EXCHANGE PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 7 278 905 | TATNEFT PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 186 | TRANSNEFT PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 811 940 | UNITED CO RUSAL INTERNATIONAL | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 10 290 823 737 | VTB BANK PJSC | RUB | 104 | 0,00 | | | | | | |
| 416 484 | X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | USD | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 140 048 | X 5 RETAIL GROUP NV-REGS GDR | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | 5 | 0,00 | | | | | | |
| 18 885 158 | NOVOROSSIYSK COMMERCIAL SEA | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 5 803 450 | OKEY GROUP SA - GDR REG | USD | 5 | 0,00 | | | | | | |
| | <i>Chypre</i> | | 5 | 0,00 | | | | | | |
| 351 590 | CIAN PLC-ADR | USD | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 2 657 727 | GLOBAL PORTS INV-REGS W/I | USD | 2 | 0,00 | | | | | | |
| 1 250 939 | GLOBALTRA-SPONS GDR REGS | USD | 1 | 0,00 | | | | | | |
| 1 210 869 | OZON HOLDINGS PLC - ADR | USD | 1 | 0,00 | | | | | | |
| 557 502 | TCS GROUP HOLDING -REG S | USD | 1 | 0,00 | | | | | | |
| 158 494 | TCS GROUP HOLDING-GDR REG S | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| | <i>Ile de Guernesey</i> | | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 510 880 | ETALON GROUP-GDR REGS - W/I | USD | 0 | 0,00 | | | | | | |
| Autres valeurs mobilières | | | | | | | | | | |
| | | | 2 | 0,00 | | | | | | |
| Actions | | | | | | | | | | |
| Russie | | | | | | | | | | |
| 14 892 463 | ALROSA PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 8 297 135 | MAGNITOGORSK IRON & STEEL WORKS PJSC | RUB | 0 | 0,00 | | | | | | |
| 1 709 408 | VK IPJSC | USD | 2 | 0,00 | | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Seasons

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 424 110 703 | 78,74 |
| Actions | | | 424 110 703 | 78,74 |
| <i>France</i> | | | <i>401 595 507</i> | <i>74,55</i> |
| 33 000 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 5 811 960 | 1,08 |
| 366 865 | AMUNDI SA | EUR | 22 598 884 | 4,20 |
| 4 686 | ATOS SE | EUR | 33 036 | 0,01 |
| 475 000 | AXA SA | EUR | 14 007 750 | 2,60 |
| 769 004 | BNP PARIBAS | EUR | 48 131 961 | 8,93 |
| 33 000 | CAPGEMINI SE | EUR | 6 228 750 | 1,16 |
| 90 000 | CARREFOUR SA | EUR | 1 490 850 | 0,28 |
| 1 932 255 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 24 833 341 | 4,61 |
| 341 234 | DANONE | EUR | 20 023 611 | 3,72 |
| 1 590 475 | ENGIE | EUR | 25 317 181 | 4,70 |
| 7 000 | KERING | EUR | 2 793 000 | 0,52 |
| 40 000 | LEGRAND SA | EUR | 3 764 000 | 0,70 |
| 9 000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 6 602 400 | 1,23 |
| 620 280 | MICHELIN (CGDE) | EUR | 20 134 289 | 3,74 |
| 3 793 012 | ORANGE | EUR | 39 083 196 | 7,26 |
| 26 000 | PERNOD RICARD SA | EUR | 4 153 500 | 0,77 |
| 115 000 | PUBLICIS GROUPE | EUR | 9 660 000 | 1,79 |
| 211 802 | SANOFI AVENTIS | EUR | 19 011 348 | 3,53 |
| 1 693 648 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 40 689 893 | 7,54 |
| 3 711 | SODEXO SA | EUR | 369 690 | 0,07 |
| 701 569 | TOTAL SA | EUR | 43 216 650 | 8,01 |
| 100 000 | VALEO SA | EUR | 1 391 500 | 0,26 |
| 792 855 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 22 643 939 | 4,20 |
| 134 364 | VINCI SA | EUR | 15 277 187 | 2,84 |
| 447 250 | VIVENDI | EUR | 4 327 591 | 0,80 |
| <i>Pays-Bas</i> | | | <i>17 208 204</i> | <i>3,20</i> |
| 11 754 | ASM INTERNATIONAL NV | EUR | 5 523 792 | 1,03 |
| 219 743 | NN GROUP NV - W/I | EUR | 7 855 812 | 1,46 |
| 67 500 | RANDSTAD HOLDING NV | EUR | 3 828 600 | 0,71 |
| <i>Allemagne</i> | | | <i>5 306 992</i> | <i>0,99</i> |
| 84 844 | MERCEDES BENZ GROUP AG | EUR | 5 306 992 | 0,99 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 26 502 165 | 4,92 |
| <i>France</i> | | | <i>26 502 165</i> | <i>4,92</i> |
| 1 125,76 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 26 502 165 | 4,92 |
| Total portefeuille-titres | | | 450 612 868 | 83,66 |

BNP PARIBAS FUNDS SMaRT Food

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|------------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|------------|---|--------------------|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 1 080 704 593 | 98,74 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>378 926 174</i> | <i>34,62</i> | | | | | |
| 277 839 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 27 684 551 | 2,53 | 287 514 | Danemark CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | DKK | 21 837 727 | 2,00 |
| 249 546 | AGCO CORP | USD | 27 427 131 | 2,51 | 830 200 | Japon SAKATA SEED CORP | JPY | 20 889 892 | 1,91 |
| 461 097 | BALL CORP | USD | 24 009 686 | 2,19 | 457 681 | Autriche LENZING AG | EUR | 16 270 560 | 1,49 |
| 691 344 | DARLING INGREDIENTS INC | USD | 31 192 310 | 2,85 | 701 104 | Portugal JERONIMO MARTINS | EUR | 16 153 436 | 1,48 |
| 241 221 | DEXCOM INC | USD | 27 097 374 | 2,48 | 35 703 600 | Philippines PUREGOLD PRICE CLUB INC | PHP | 15 703 565 | 1,43 |
| 154 172 | ECOLAB INC | USD | 27 682 991 | 2,53 | 12 714 000 | Hong-Kong VITASOY INTERNATIONAL HOLDINGS | HKD | 11 475 226 | 1,05 |
| 1 443 836 | GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO | USD | 32 218 854 | 2,94 | | Total portefeuille-titres | | 1 080 704 593 | 98,74 |
| 298 566 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES | USD | 21 884 659 | 2,00 | | | | | |
| 407 957 | MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | USD | 25 268 110 | 2,31 | | | | | |
| 165 184 | MIDDLEBY CORP | USD | 22 007 088 | 2,01 | | | | | |
| 907 914 | RAYONIER INC | USD | 27 459 744 | 2,51 | | | | | |
| 539 136 | SONOCO PRODUCTS CO | USD | 27 267 939 | 2,49 | | | | | |
| 398 750 | TRIMBLE INC | USD | 19 203 820 | 1,75 | | | | | |
| 120 277 | VALMONT INDUSTRIES | USD | 25 425 141 | 2,32 | | | | | |
| 348 443 | WESTROCK CO | USD | 13 096 776 | 1,20 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>113 662 679</i> | <i>10,37</i> | | | | | |
| 2 533 348 | DOLE PLC | USD | 28 185 260 | 2,58 | | | | | |
| 1 425 695 | GLANBIA PLC | EUR | 21 257 112 | 1,94 | | | | | |
| 511 023 | KERRY GROUP PLC - A | EUR | 40 197 068 | 3,66 | | | | | |
| 669 544 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 24 023 239 | 2,19 | | | | | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>99 538 431</i> | <i>9,10</i> | | | | | |
| 270 836 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 24 916 912 | 2,28 | | | | | |
| 184 126 | NESTLE SA-REG | CHF | 19 311 742 | 1,76 | | | | | |
| 398 093 | SGS SA-REG | CHF | 31 061 274 | 2,84 | | | | | |
| 1 165 056 | SIG COMBIBLOC GROUP AG | CHF | 24 248 503 | 2,22 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>70 414 993</i> | <i>6,43</i> | | | | | |
| 2 565 044 | CNH INDUSTRIAL NV | USD | 28 282 475 | 2,58 | | | | | |
| 1 032 120 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 25 560 320 | 2,34 | | | | | |
| 378 188 | UNILEVER PLC | EUR | 16 572 198 | 1,51 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>63 236 579</i> | <i>5,78</i> | | | | | |
| 838 730 | GEA GROUP AG | EUR | 31 611 734 | 2,89 | | | | | |
| 696 993 | HELLOFRESH SE | EUR | 9 973 970 | 0,91 | | | | | |
| 217 291 | SYMRISE AG | EUR | 21 650 875 | 1,98 | | | | | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>49 287 175</i> | <i>4,50</i> | | | | | |
| 1 541 373 | BORREGAARD ASA | NOK | 23 549 613 | 2,15 | | | | | |
| 6 900 976 | LEROY SEAFOOD GROUP ASA | NOK | 25 737 562 | 2,35 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>49 061 828</i> | <i>4,48</i> | | | | | |
| 1 165 396 | CORBION NV | EUR | 22 585 374 | 2,06 | | | | | |
| 1 017 738 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | EUR | 26 476 454 | 2,42 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>34 348 044</i> | <i>3,14</i> | | | | | |
| 585 345 | DANONE | EUR | 34 348 044 | 3,14 | | | | | |
| | <i>Iles Féroé</i> | | <i>33 786 659</i> | <i>3,09</i> | | | | | |
| 712 473 | BAKKA Frost P/F | NOK | 33 786 659 | 3,09 | | | | | |
| | <i>Inde</i> | | <i>31 152 831</i> | <i>2,85</i> | | | | | |
| 5 137 783 | DABUR INDIA LTD | INR | 31 152 831 | 2,85 | | | | | |
| | <i>Canada</i> | | <i>28 967 538</i> | <i>2,65</i> | | | | | |
| 402 462 | CANADIAN PACIFIC KANSAS CITY | CAD | 28 967 538 | 2,65 | | | | | |
| | <i>Australie</i> | | <i>25 991 256</i> | <i>2,37</i> | | | | | |
| 3 093 915 | BRAMBLES LTD | AUD | 25 991 256 | 2,37 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Social Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Obligations | | 161 154 919 | 81,29 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>70 180 782</i> | <i>35,41</i> | | | | | |
| 100 000 | ACTION LOGEMENT 0,750% 21-19/07/2041 | EUR | 65 836 | 0,03 | 300 000 | UNEDIC 0,100% 21-25/05/2034 | EUR | 229 299 | 0,12 |
| 1 000 000 | ACTION LOGEMENT 1,375% 22-13/04/2032 | EUR | 890 360 | 0,45 | 200 000 | UNEDIC 1,750% 22-25/11/2032 | EUR | 186 836 | 0,09 |
| 500 000 | ACTION LOGEMENT 3,625% 23-25/05/2043 | EUR | 512 694 | 0,26 | 800 000 | VILLE DE PARIS 3,000% 22-27/09/2042 | EUR | 755 622 | 0,38 |
| 1 200 000 | ACTION LOGEMENT 4,125% 23-03/10/2038 | EUR | 1 307 412 | 0,66 | <i>Espagne</i> | | | | |
| 2 800 000 | AGENCE FRANCAISE 0,000% 20-20/09/2027 | EUR | 2 534 383 | 1,28 | 1 000 000 | AUTONOMOUS COMMU 1,723% 22-30/04/2032 | EUR | 898 688 | 0,45 |
| 600 000 | AGENCE FRANCAISE 0,000% 20-28/10/2027 | EUR | 542 634 | 0,27 | 500 000 | AUTONOMOUS COMMU 3,596% 23-30/04/2033 | EUR | 517 916 | 0,26 |
| 500 000 | AGENCE FRANCAISE 1,625% 22-25/05/2032 | EUR | 455 810 | 0,23 | 3 600 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 0,750% 20-04/06/2025 | EUR | 3 468 320 | 1,75 |
| 400 000 | AGENCE FRANCAISE 2,875% 23-21/01/2030 | EUR | 404 112 | 0,20 | 200 000 | BASQUE GOVERNMENT 0,450% 21-30/04/2032 | EUR | 162 743 | 0,08 |
| 3 300 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,000% 22-21/11/2029 | EUR | 3 415 621 | 1,72 | 2 100 000 | BASQUE GOVERNMENT 1,450% 18-30/04/2028 | EUR | 1 990 398 | 1,00 |
| 500 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL 4,125% 23-18/09/2030 | EUR | 524 539 | 0,26 | 500 000 | BASQUE GOVERNMENT 1,875% 22-30/07/2033 | EUR | 447 988 | 0,23 |
| 2 000 000 | BPIFRANCE 3,500% 23-27/09/2027 | EUR | 2 062 060 | 1,04 | 200 000 | BASQUE GOVERNMENT 3,500% 23-30/04/2033 | EUR | 206 619 | 0,10 |
| 600 000 | CAISSE AMORT DET 0,000% 20-25/02/2026 | EUR | 567 109 | 0,29 | 500 000 | COMUNIDAD MADRID 0,420% 21-30/04/2031 | EUR | 414 189 | 0,21 |
| 500 000 | CAISSE AMORT DET 0,000% 21-25/05/2031 | EUR | 413 173 | 0,21 | 5 000 000 | INSTIT CRDT OFCL 2,650% 22-31/01/2028 | EUR | 4 981 926 | 2,51 |
| 100 000 | CAISSE AMORT DET 0,450% 22-19/01/2032 | EUR | 84 253 | 0,04 | 1 200 000 | INSTIT CRDT OFCL 3,250% 23-31/10/2028 | EUR | 1 230 086 | 0,62 |
| 300 000 | CAISSE AMORT DET 1,500% 22-25/05/2032 | EUR | 274 510 | 0,14 | 1 200 000 | JUNTA ANDALUCIA 0,500% 21-30/04/2031 | EUR | 996 483 | 0,50 |
| 100 000 | CAISSE AMORT DET 1,750% 22-25/11/2027 | EUR | 97 095 | 0,05 | 1 499 000 | JUNTA ANDALUCIA 2,400% 22-30/04/2032 | EUR | 1 412 568 | 0,71 |
| 600 000 | CAISSE AMORT DET 2,750% 22-25/11/2032 | EUR | 604 455 | 0,30 | 600 000 | JUNTA CASTILLA 3,500% 23-30/04/2033 | EUR | 611 717 | 0,31 |
| 800 000 | CAISSE AMORT DET 2,875% 22-25/05/2027 | EUR | 807 900 | 0,41 | 1 400 000 | TELEFONICA EMIS 2,592% 22-25/05/2031 | EUR | 1 344 912 | 0,68 |
| 1 500 000 | CAISSE AMORT DET 3,000% 23-25/05/2028 | EUR | 1 529 437 | 0,77 | 3 000 000 | XUNTA DE GALICIA 3,711% 23-30/07/2029 | EUR | 3 124 170 | 1,58 |
| 2 900 000 | CAISSE AMORT DET 3,750% 23-24/05/2028 | USD | 2 587 464 | 1,31 | <i>Belgique</i> | | | | |
| 3 600 000 | CAISSE DES DEPOT 0,010% 21-01/06/2026 | EUR | 3 376 193 | 1,70 | 1 100 000 | COMM FRANC BELG 0,625% 21-11/06/2035 | EUR | 833 667 | 0,42 |
| 2 000 000 | CAISSE DES DEPOT 3,000% 23-25/05/2028 | EUR | 2 042 590 | 1,03 | 200 000 | COMM FRANC BELG 1,625% 22-03/05/2032 | EUR | 181 770 | 0,09 |
| 900 000 | CAISSE DES DEPOT 3,375% 23-25/11/2030 | EUR | 943 991 | 0,48 | 4 300 000 | EUROPEAN UNION 0,000% 20-04/10/2030 | EUR | 3 653 452 | 1,84 |
| 7 200 000 | CAISSE FR DE FINANCEMENT 0,500% 19-19/02/2027 | EUR | 6 713 921 | 3,40 | 1 800 000 | EUROPEAN UNION 0,000% 20-04/11/2025 | EUR | 1 720 073 | 0,87 |
| 400 000 | CIE FIN FONCIER 3,625% 23-16/01/2029 | EUR | 416 066 | 0,21 | 2 500 000 | EUROPEAN UNION 0,000% 21-04/03/2026 | EUR | 2 375 963 | 1,20 |
| 3 000 000 | COUNCIL OF EUROP 0,000% 21-15/04/2028 | EUR | 2 705 285 | 1,36 | 951 000 | EUROPEAN UNION 2,750% 22-04/12/2037 | EUR | 933 901 | 0,47 |
| 1 500 000 | COUNCIL OF EUROP 1,000% 22-13/04/2029 | EUR | 1 394 715 | 0,70 | 1 800 000 | FLEMISH COMMUNIT 0,375% 20-15/04/2030 | EUR | 1 562 725 | 0,79 |
| 500 000 | COUNCIL OF EUROP 2,875% 23-13/04/2030 | EUR | 511 706 | 0,26 | 500 000 | FLEMISH COMMUNIT 4,000% 23-26/09/2042 | EUR | 547 397 | 0,28 |
| 400 000 | CREDIT AGRICOLE HOME L 3,250% 23-08/06/2033 | EUR | 410 678 | 0,21 | 1 800 000 | KBC GROUP NV 3,000% 22-25/08/2030 | EUR | 1 752 357 | 0,88 |
| 1 500 000 | CREDIT AGRICOLE SA 0,125% 20-09/12/2027 | EUR | 1 331 211 | 0,67 | 1 200 000 | KBC GROUP NV 4,375% 23-06/12/2031 | EUR | 1 263 286 | 0,64 |
| 900 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 3,875% 23-22/05/2028 | EUR | 919 061 | 0,46 | <i>Allemagne</i> | | | | |
| 900 000 | DANONE 1,000% 18-26/03/2025 | EUR | 874 339 | 0,44 | 2 200 000 | ADIDAS AG 0,000% 20-05/10/2028 | EUR | 1 940 742 | 0,98 |
| 3 700 000 | ICADE SANTE SAS 1,375% 20-17/09/2030 | EUR | 3 049 141 | 1,54 | 500 000 | BERLIN HYP AG 3,000% 23-11/05/2026 | EUR | 503 432 | 0,25 |
| 4 200 000 | ILE DE FRANCE 0,000% 21-20/04/2028 | EUR | 3 751 727 | 1,89 | 707 000 | BERLIN HYP AG 3,375% 23-23/08/2028 | EUR | 730 405 | 0,37 |
| 5 100 000 | LA BANQUE POSTALE 0,750% 21-23/06/2031 | EUR | 4 179 534 | 2,11 | 2 800 000 | LEG IMMOBILIE SE 0,750% 21-30/06/2031 | EUR | 2 217 318 | 1,12 |
| 1 800 000 | LA BANQUE POSTALE 3,000% 23-31/01/2031 | EUR | 1 826 546 | 0,92 | 800 000 | NORDRHEIN-WEST 0,000% 20-12/10/2035 | EUR | 581 074 | 0,29 |
| 4 500 000 | LA POSTE SA 3,125% 22-14/09/2028 | EUR | 4 445 646 | 2,24 | 2 700 000 | NORDRHEIN-WEST 2,000% 22-15/06/2032 | EUR | 2 585 748 | 1,30 |
| 2 900 000 | ORANGE 0,125% 20-16/09/2029 | EUR | 2 497 572 | 1,26 | 1 200 000 | NORDRHEIN-WEST 2,900% 23-07/06/2033 | EUR | 1 231 195 | 0,62 |
| 700 000 | ORANGE 2,375% 22-18/05/2032 | EUR | 670 426 | 0,34 | 2 000 000 | NRW BANK 0,100% 20-09/07/2035 | EUR | 1 473 116 | 0,74 |
| 900 000 | SOCIETE GENERALE 4,125% 23-21/11/2028 | EUR | 931 196 | 0,47 | 800 000 | NRW BANK 2,875% 23-05/04/2033 | EUR | 816 463 | 0,41 |
| 6 800 000 | UNEDIC 0,100% 20-25/11/2026 | EUR | 6 336 624 | 3,21 | 800 000 | VONOVIA SE 1,375% 22-28/01/2026 | EUR | 764 023 | 0,39 |
| | | | | | 1 400 000 | VONOVIA SE 4,750% 22-23/05/2027 | EUR | 1 450 074 | 0,73 |
| | | | | | <i>Italie</i> | | | | |
| | | | | | 3 000 000 | ASSICURAZIONI 1,713% 21-30/06/2032 | EUR | 2 401 696 | 1,21 |
| | | | | | 349 000 | BANCO BPM SPA 4,625% 23-29/11/2027 | EUR | 359 360 | 0,18 |
| | | | | | 7 100 000 | CASSA DEPOSITI E 1,000% 20-21/09/2028 | EUR | 6 376 918 | 3,23 |

BNP PARIBAS FUNDS Social Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | |
|-----------------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|-------------|
| 600 000 | CASSA DEPOSITI E 2,125% 19-21/03/2026 | EUR | 586 424 | 0,30 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | | |
| 3 064 000 | INTESA SANPAOLO 5,250% 22-13/01/2030 | EUR | 3 280 982 | 1,66 | | | | | | |
| 800 000 | TELECOM ITALIA 1,625% 21-18/01/2029 | EUR | 692 152 | 0,35 | France | | | | | |
| Pays-Bas | | | | 6 166 758 | | | | | | 3,10 |
| 645 000 | BNG BANK NV 3,000% 23-11/01/2033 | EUR | 659 019 | 0,33 | 5 337,24 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 6 037 690 | 3,05 | |
| 1 300 000 | BNG BANK NV 3,250% 23-29/08/2033 | EUR | 1 357 150 | 0,68 | Total portefeuille-titres | | | | | |
| 3 000 000 | BNG BANK NV 3,500% 23-19/05/2028 | USD | 2 655 123 | 1,34 | | | | | | 192 369 516 |
| 1 800 000 | NED WATERSCHAPBK 0,250% 22-19/01/2032 | EUR | 1 495 466 | 0,75 | Etats-Unis d'Amérique | | | | | |
| Etats-Unis d'Amérique | | | | 5 102 024 | | | | | | 2,57 |
| 1 900 000 | ELI LILLY & CO 0,500% 21-14/09/2033 | EUR | 1 545 336 | 0,78 | Chili | | | | | |
| 4 100 000 | FEDEX CORP 0,450% 21-04/05/2029 | EUR | 3 556 688 | 1,79 | | | | | | |
| Chili | | | | 4 735 377 | 2,39 | Royaume-Uni | | | | |
| 4 300 000 | CHILE 0,100% 21-26/01/2027 | EUR | 3 898 122 | 1,97 | | | | | | |
| 1 500 000 | CHILE 1,250% 21-22/01/2051 | EUR | 837 255 | 0,42 | Slovénie | | | | | |
| Royaume-Uni | | | | 3 850 460 | | | | | | 1,94 |
| 2 600 000 | MOTABILITY OPS 0,125% 21-20/07/2028 | EUR | 2 284 536 | 1,15 | Corée du Sud | | | | | |
| 1 529 000 | MOTABILITY OPS 3,500% 23-17/07/2031 | EUR | 1 565 924 | 0,79 | | | | | | |
| Slovénie | | | | 3 122 207 | 1,58 | Finlande | | | | |
| 3 800 000 | REPUBLIC OF SLOVENIA 0,125% 21-01/07/2031 | EUR | 3 122 207 | 1,58 | | | | | | |
| Corée du Sud | | | | 2 419 235 | 1,22 | Obligations à taux flottant | | | | |
| 1 500 000 | KHFC 1,963% 22-19/07/2026 | EUR | 1 456 395 | 0,73 | | | | | | |
| 932 000 | KHFC 4,082% 23-25/09/2027 | EUR | 962 840 | 0,49 | France | | | | | |
| Finlande | | | | 953 640 | | | | | | 0,48 |
| 1 300 000 | KUNTARAHOITUS 0,050% 20-10/09/2035 | EUR | 953 640 | 0,48 | France | | | | | |
| France | | | | 8 889 944 | | | | | | 4,49 |
| 800 000 | BPCE 23-01/06/2033 FRN | EUR | 844 853 | 0,43 | Royaume-Uni | | | | | |
| 700 000 | CNP ASSURANCES 23-18/07/2053 FRN | EUR | 722 812 | 0,36 | | | | | | |
| 2 200 000 | CREDIT AGRICOLE SA 22-12/10/2026 FRN | EUR | 2 217 003 | 1,12 | Etats-Unis d'Amérique | | | | | |
| 2 600 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA 20-11/06/2029 FRN | EUR | 2 356 201 | 1,19 | | | | | | |
| 3 000 000 | SOCIETE GENERALE 21-02/12/2027 FRN | EUR | 2 749 075 | 1,39 | Espagne | | | | | |
| Royaume-Uni | | | | 3 476 382 | | | | | | 1,75 |
| 800 000 | NATWEST GROUP 21-26/02/2030 FRN | EUR | 688 115 | 0,35 | Irlande | | | | | |
| 1 199 000 | NATWEST GROUP 23-14/03/2028 FRN | EUR | 1 233 093 | 0,62 | | | | | | |
| 1 600 000 | ROYAL BANK OF SCOTLAND 19-15/11/2025 FRN | EUR | 1 555 174 | 0,78 | Italie | | | | | |
| Etats-Unis d'Amérique | | | | 3 043 599 | | | | | | 1,54 |
| 3 500 000 | MORGAN STANLEY 20-21/10/2025 FRN | USD | 3 043 599 | 1,54 | Pays-Bas | | | | | |
| Espagne | | | | 2 918 188 | | | | | | 1,48 |
| 1 300 000 | CAIXABANK 21-26/05/2028 FRN | EUR | 1 183 772 | 0,60 | Irlande | | | | | |
| 1 700 000 | CAIXABANK 23-16/05/2027 FRN | EUR | 1 734 416 | 0,88 | | | | | | |
| Irlande | | | | 2 873 572 | 1,45 | Italie | | | | |
| 3 000 000 | AIB GROUP PLC 22-04/04/2028 FRN | EUR | 2 873 572 | 1,45 | | | | | | |
| Italie | | | | 2 500 746 | 1,26 | Pays-Bas | | | | |
| 938 000 | CREDITO EMILIANO 23-26/03/2030 FRN | EUR | 967 318 | 0,49 | | | | | | |
| 864 000 | MEDIOBANCA SPA 22-07/02/2029 FRN | EUR | 898 153 | 0,45 | Pays-Bas | | | | | |
| 618 000 | MEDIOBANCA SPA 23-13/09/2027 FRN | EUR | 635 275 | 0,32 | | | | | | |
| Pays-Bas | | | | 1 474 476 | 0,74 | Pays-Bas | | | | |
| 1 700 000 | TELEFONICA EUROP 21-31/12/2061 FRN | EUR | 1 474 476 | 0,74 | | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Asia ex-Japan Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 272 020 366 | 96,21 |
| Actions | | | 272 020 366 | 96,21 |
| <i>Chine</i> | | | <i>66 105 522</i> | <i>23,38</i> |
| 320 000 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | HKD | 3 087 197 | 1,09 |
| 357 750 | BAIDU INC - A | HKD | 5 343 485 | 1,89 |
| 144 500 | BYD CO LTD-H | HKD | 3 984 013 | 1,41 |
| 537 000 | BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | HKD | 2 519 864 | 0,89 |
| 1 040 000 | CHINA MENGNIU DAIRY CO | HKD | 2 804 086 | 0,99 |
| 48 114 000 | CHINA TOWER CORP LTD-H | HKD | 5 056 967 | 1,79 |
| 135 021 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A | CNY | 3 112 060 | 1,10 |
| 15 421 | KWEICHOW MOUTAI CO LTD - A | CNY | 3 755 610 | 1,33 |
| 319 700 | NETEASE INC | HKD | 5 771 480 | 2,04 |
| 903 000 | PING AN INSURANCE GROUP CO - H | HKD | 4 089 487 | 1,45 |
| 479 094 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 18 086 744 | 6,40 |
| 236 900 | TRIP.COM GROUP LTD | HKD | 8 494 529 | 3,00 |
| <i>Corée du Sud</i> | | | <i>52 866 014</i> | <i>18,70</i> |
| 175 434 | KT CORP | KRW | 4 686 263 | 1,66 |
| 40 659 | LG ELECTRONICS INC | KRW | 3 213 091 | 1,14 |
| 10 778 | LG ENERGY SOLUTION | KRW | 3 578 414 | 1,27 |
| 459 963 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | KRW | 28 028 789 | 9,90 |
| 10 011 | SAMSUNG SDI CO LTD | KRW | 3 670 237 | 1,30 |
| 88 239 | SK HYNIX INC | KRW | 9 689 220 | 3,43 |
| <i>Inde</i> | | | <i>49 365 297</i> | <i>17,46</i> |
| 485 123 | BHARTI AIRTEL LTD | INR | 6 020 570 | 2,13 |
| 630 888 | HDFC BANK LIMITED | INR | 12 950 635 | 4,58 |
| 186 845 | HINDUSTAN UNILEVER LTD | INR | 5 984 954 | 2,12 |
| 769 728 | JUBILANT FOODWORKS LTD | INR | 5 228 085 | 1,85 |
| 249 237 | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | INR | 5 181 992 | 1,83 |
| 15 684 | NESTLE INDIA LTD | INR | 5 009 621 | 1,77 |
| 289 252 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | INR | 8 989 440 | 3,18 |
| <i>Taiwan</i> | | | <i>40 536 222</i> | <i>14,33</i> |
| 1 160 760 | CHAILEASE HOLDING CO LTD | TWD | 7 299 320 | 2,58 |
| 1 460 000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 28 179 703 | 9,96 |
| 85 000 | WIWYNN CORP | TWD | 5 057 199 | 1,79 |
| <i>Singapour</i> | | | <i>18 189 446</i> | <i>6,43</i> |
| 579 000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD | SGD | 14 658 793 | 5,18 |
| 1 694 617 | SATS LTD | SGD | 3 530 653 | 1,25 |
| <i>Hong-Kong</i> | | | <i>17 154 058</i> | <i>6,07</i> |
| 1 348 400 | AIA GROUP LTD | HKD | 11 765 919 | 4,16 |
| 451 500 | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | HKD | 5 388 139 | 1,91 |
| <i>Thaïlande</i> | | | <i>12 168 392</i> | <i>4,30</i> |
| 2 287 900 | AIRPORTS OF THAILAND PCL-FOR | THB | 4 023 003 | 1,42 |
| 5 264 900 | BANGKOK DUSIT MED SERVICE - F | THB | 4 202 112 | 1,49 |
| 26 920 200 | WHA CORP PCL-FOREIGN | THB | 3 943 277 | 1,39 |
| <i>Suisse</i> | | | <i>4 313 773</i> | <i>1,53</i> |
| 76 761 | ABB INDIA LTD | INR | 4 313 773 | 1,53 |
| <i>Irlande</i> | | | <i>4 283 957</i> | <i>1,52</i> |
| 29 280 | PINDUODUO INC - ADR | USD | 4 283 957 | 1,52 |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | <i>3 531 109</i> | <i>1,25</i> |
| 83 222 | YUM CHINA HOLDINGS INC | USD | 3 531 109 | 1,25 |
| <i>Malaisie</i> | | | <i>3 506 576</i> | <i>1,24</i> |
| 3 351 200 | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDIN | MYR | 3 506 576 | 1,24 |
| Total portefeuille-titres | | | 272 020 366 | 96,21 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Asian Cities Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|------------------------------------|---------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Obligations | | | | | | | | | |
| 68 988 239 | | | | | 85,58 | | | | |
| <i>Corée du Sud</i> | | | | | <i>13 515 124</i> | | | | |
| <i>16,77</i> | | | | | | | | | |
| 1 500 000 | EXP-IMP BK KOREA 5,125% 23-11/01/2033 | USD | 1 559 100 | 1,93 | 800 000 | 10 RENEW PW SUB 4,500% 21-14/07/2028 | USD | 710 880 | 0,88 |
| 1 200 000 | KHFC 4,625% 23-24/02/2028 | USD | 1 196 640 | 1,48 | 1 800 000 | ADANI GREEN/PR 6,250% 19-10/12/2024 | USD | 1 775 250 | 2,20 |
| 700 000 | KHFC 4,625% 23-24/02/2033 | USD | 683 564 | 0,85 | 2 103 000 | ADANI RENEW ENER 4,625% 19-15/10/2039 | USD | 1 640 340 | 2,04 |
| 2 500 000 | KODIT GLB 2023-1 4,954% 23-25/05/2026 | USD | 2 494 725 | 3,10 | 1 700 000 | SHRIRAM TRANSPOR 4,400% 21-13/03/2024 | USD | 1 684 700 | 2,09 |
| 1 100 000 | LG CHEM LTD 1,375% 21-07/07/2026 | USD | 1 002 221 | 1,24 | 1 000 000 | ULTRATECH CEMENT 2,800% 21-16/02/2031 | USD | 848 970 | 1,05 |
| 3 500 000 | SHINHAN FINL GRP 5,000% 23-24/07/2028 | USD | 3 494 574 | 4,34 | <i>Iles Vierges britanniques</i> | | | | |
| 1 000 000 | SK BROADBAND CO 4,875% 23-28/06/2028 | USD | 999 880 | 1,24 | <i>4 346 790</i> | | | | |
| 2 071 000 | SK ON CO LTD 5,375% 23-11/05/2026 | USD | 2 084 420 | 2,59 | 1 800 000 | MIDEA INVST DEV 2,880% 22-24/02/2027 | USD | 1 690 362 | 2,10 |
| <i>Indonésie</i> | | | | | <i>12 253 405</i> | | | | |
| <i>15,21</i> | | | | | | | | | |
| 2 000 000 | BANK MANDIRI PT 2,000% 21-19/04/2026 | USD | 1 858 750 | 2,31 | 1 116 000 | TSMC GLOBAL LTD 0,750% 20-28/09/2025 | USD | 1 037 768 | 1,29 |
| 500 000 | BANK RAKYAT INDO 3,950% 19-28/03/2024 | USD | 497 275 | 0,62 | 2 000 000 | TSMC GLOBAL LTD 1,375% 20-28/09/2030 | USD | 1 618 660 | 2,01 |
| 2 100 000 | PERTAMINA GEOTHE 5,150% 23-27/04/2028 | USD | 2 103 938 | 2,61 | <i>Malaisie</i> | | | | |
| 1 700 000 | SBSN INDO III 2,300% 20-23/06/2025 | USD | 1 633 700 | 2,03 | <i>2 221 159</i> | | | | |
| 3 400 000 | SBSN INDO III 3,550% 21-09/06/2051 | USD | 2 724 250 | 3,38 | 1 600 000 | AXIATA SPV2 4,357% 16-24/03/2026 | USD | 1 575 296 | 1,95 |
| 2 200 000 | SBSN INDO III 5,600% 23-15/11/2033 | USD | 2 340 492 | 2,90 | 750 000 | MY WAKALA SUKUK 2,070% 21-28/04/2031 | USD | 645 863 | 0,80 |
| 1 200 000 | TOWER BERSAMA IN 2,800% 21-02/05/2027 | USD | 1 095 000 | 1,36 | <i>Philippines</i> | | | | |
| <i>Hong-Kong</i> | | | | | <i>1 701 875</i> | | | | |
| <i>8 272 759</i> | | | | | <i>2,11</i> | | | | |
| 1 500 000 | CHINA WATER AFF 4,850% 21-18/05/2026 | USD | 1 275 000 | 1,58 | 1 750 000 | BANK PHILIPP ISL 2,500% 19-10/09/2024 | USD | 1 701 875 | 2,11 |
| 550 000 | CHN MERCH BK/HK 1,200% 20-10/09/2025 | USD | 515 779 | 0,64 | <i>Ile Maurice</i> | | | | |
| 500 000 | HONG KONG 4,000% 23-07/06/2028 | USD | 499 936 | 0,62 | <i>1 651 125</i> | | | | |
| 1 000 000 | HONG KONG 4,250% 23-07/06/2026 | USD | 998 105 | 1,24 | 1 700 000 | GREENKO SOLAR 5,950% 19-29/07/2026 | USD | 1 651 125 | 2,05 |
| 1 400 000 | HONG KONG 5,250% 23-11/01/2053 | USD | 1 572 912 | 1,95 | <i>Emirats Arabes Unis</i> | | | | |
| 1 500 000 | HYSAN MTN LTD 2,82% 19-04/09/2029 | USD | 1 302 521 | 1,62 | <i>1 403 434</i> | | | | |
| 1 350 000 | MTR CORP LTD 1,625% 20-19/08/2030 | USD | 1 130 027 | 1,40 | 1 423 000 | MASDAR ABU 4,875% 23-25/07/2033 | USD | 1 403 434 | 1,74 |
| 725 000 | VANKE REAL ESTAT 3,150% 19-12/05/2025 | USD | 592 688 | 0,74 | <i>Australie</i> | | | | |
| 450 000 | YUEXIU REIT MTN 2,650% 21-02/02/2026 | USD | 385 791 | 0,48 | <i>993 740</i> | | | | |
| <i>Chine</i> | | | | | <i>1,23</i> | | | | |
| <i>8 259 353</i> | | | | | | | | | |
| 2 600 000 | ALIBABA GROUP 2,700% 21-09/02/2041 | USD | 1 770 990 | 2,20 | 1 000 000 | CHN CONST BK/SYD 4,500% 23-31/05/2026 | USD | 993 740 | 1,23 |
| 600 000 | BAIDU INC 1,625% 21-23/02/2027 | USD | 542 568 | 0,67 | <i>Singapour</i> | | | | |
| 2 000 000 | BAIDU INC 2,375% 21-23/08/2031 | USD | 1 644 020 | 2,04 | <i>488 790</i> | | | | |
| 550 000 | CHN CONST BK/HK 1,250% 20-04/08/2025 | USD | 518 507 | 0,64 | 500 000 | BANK OF CHINA/SG 3,250% 22-28/04/2025 | USD | 488 790 | 0,61 |
| 800 000 | LENOVO GROUP LTD 3,421% 20-02/11/2030 | USD | 705 008 | 0,87 | Obligations à taux flottant | | | | |
| 700 000 | LENOVO GROUP LTD 6,536% 22-27/07/2032 | USD | 746 410 | 0,93 | 9 817 752 | | | | |
| 1 000 000 | LONGFOR HOLDINGS 3,950% 19-16/09/2029 | USD | 460 000 | 0,57 | 12,19 | | | | |
| 1 800 000 | LONGFOR PROPRTI 4,500% 18-16/01/2028 | USD | 945 000 | 1,17 | <i>Singapour</i> | | | | |
| 1 000 000 | SF HLD INV 2021 2,375% 21-17/11/2026 | USD | 926 850 | 1,15 | <i>3 816 297</i> | | | | |
| <i>Iles Caïmans</i> | | | | | <i>4,74</i> | | | | |
| <i>7 220 545</i> | | | | | | | | | |
| 1 000 000 | CHINA OVERSEA FI 6,375% 13-29/10/2043 | USD | 970 110 | 1,20 | 2 000 000 | GLP PTE LTD 21-31/12/2061 FRN | USD | 626 505 | 0,78 |
| 3 800 000 | HK LAND FINANCE 5,250% 23-14/07/2033 | USD | 3 789 304 | 4,69 | 3 500 000 | UNITED OVERSEAS 21-14/10/2031 FRN | USD | 3 189 792 | 3,96 |
| 1 000 000 | LINK FIN CAYM 09 2,750% 22-19/01/2032 | USD | 840 468 | 1,04 | <i>Hong-Kong</i> | | | | |
| 1 700 000 | LINK FIN CAYM 09 2,875% 16-21/07/2026 | USD | 1 620 663 | 2,01 | <i>2 995 080</i> | | | | |
| | | | | | <i>3,72</i> | | | | |
| | | | | | <i>2 008 125</i> | | | | |
| | | | | | <i>2,49</i> | | | | |
| | | | | | <i>998 250</i> | | | | |
| | | | | | <i>1,24</i> | | | | |
| | | | | | <i>868 422</i> | | | | |
| | | | | | <i>1,08</i> | | | | |
| | | | | | <i>868 422</i> | | | | |
| | | | | | <i>1,08</i> | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 79 674 413 | | | | |
| | | | | | 98,85 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Euro Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 400 000 | ELEC DE FRANCE 22-06/12/2171 FRN | EUR | 435 964 | 0,12 | | | | | |
| 800 000 | LA BANQUE POSTALE 21-02/08/2032 FRN | EUR | 702 827 | 0,19 | | | | | |
| 900 000 | LA BANQUE POSTALE 22-05/03/2034 FRN | EUR | 941 476 | 0,25 | | | | | |
| 3 300 000 | LA POSTE 18-31/12/2049 FRN | EUR | 3 161 565 | 0,84 | | | | | |
| 300 000 | ORANGE 19-31/12/2049 FRN | EUR | 291 181 | 0,08 | | | | | |
| 1 600 000 | ORANGE 21-31/12/2061 FRN | EUR | 1 360 168 | 0,36 | | | | | |
| 1 500 000 | SOCIETE GENERALE 23-21/11/2031 FRN | EUR | 1 567 203 | 0,42 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>8 383 624</i> | <i>2,22</i> | | | | | |
| 700 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 19-31/12/2049 FRN | EUR | 690 507 | 0,18 | | | | | |
| 1 300 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 20-31/12/2060 FRN | EUR | 1 220 986 | 0,32 | | | | | |
| 900 000 | IBERDROLA INTERNATIONAL 21-31/12/2061 FRN | EUR | 817 878 | 0,22 | | | | | |
| 1 100 000 | ING GROEP NV 17-15/02/2029 FRN | EUR | 1 096 429 | 0,29 | | | | | |
| 900 000 | ING GROEP NV 21-09/06/2032 FRN | EUR | 808 113 | 0,21 | | | | | |
| 1 200 000 | TELEFONICA EUROP 18-31/12/2049 FRN | EUR | 1 160 020 | 0,31 | | | | | |
| 400 000 | TELEFONICA EUROP 23-03/05/2171 FRN | EUR | 410 989 | 0,11 | | | | | |
| 2 250 000 | TENNET HLD BV 20-22/10/2168 FRN | EUR | 2 178 702 | 0,58 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>7 873 179</i> | <i>2,09</i> | | | | | |
| 1 500 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 19-22/02/2029 FRN | EUR | 1 494 401 | 0,40 | | | | | |
| 100 000 | BANCO SANTANDER 21-24/06/2029 FRN | EUR | 88 461 | 0,02 | | | | | |
| 1 200 000 | BANKINTER SA 21-23/12/2032 FRN | EUR | 1 068 227 | 0,28 | | | | | |
| 1 200 000 | CAIXABANK 20-18/11/2026 FRN | EUR | 1 129 237 | 0,30 | | | | | |
| 1 700 000 | CAIXABANK 23-16/05/2027 FRN | EUR | 1 734 416 | 0,46 | | | | | |
| 2 400 000 | MAPFRE 17-31/03/2047 FRN | EUR | 2 358 437 | 0,63 | | | | | |
| | <i>Italie</i> | | <i>4 939 149</i> | <i>1,31</i> | | | | | |
| 1 111 000 | INTESA SANPAOLO 23-08/03/2028 FRN | EUR | 1 148 950 | 0,31 | | | | | |
| 1 441 000 | INTESA SANPAOLO 23-20/02/2034 FRN | EUR | 1 520 871 | 0,40 | | | | | |
| 1 387 000 | MEDIOBANCA SPA 22-07/02/2029 FRN | EUR | 1 441 826 | 0,38 | | | | | |
| 805 000 | MEDIOBANCA SPA 23-13/09/2027 FRN | EUR | 827 502 | 0,22 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>4 862 679</i> | <i>1,30</i> | | | | | |
| 1 223 000 | AIB GROUP PLC 21-17/11/2027 FRN | EUR | 1 121 586 | 0,30 | | | | | |
| 819 000 | AIB GROUP PLC 22-04/07/2026 FRN | EUR | 818 822 | 0,22 | | | | | |
| 709 000 | AIB GROUP PLC 22-16/02/2029 FRN | EUR | 761 672 | 0,20 | | | | | |
| 1 326 000 | BANK OF IRELAND 21-10/05/2027 FRN | EUR | 1 232 439 | 0,33 | | | | | |
| 870 000 | BANK OF IRELAND 23-04/07/2031 FRN | EUR | 928 160 | 0,25 | | | | | |
| | <i>Belgique</i> | | <i>3 064 015</i> | <i>0,81</i> | | | | | |
| 1 300 000 | KBC GROUP NV 19-03/12/2029 FRN | EUR | 1 245 498 | 0,33 | | | | | |
| 1 800 000 | KBC GROUP NV 23-06/06/2026 FRN | EUR | 1 818 517 | 0,48 | | | | | |
| | <i>Finlande</i> | | <i>1 914 024</i> | <i>0,51</i> | | | | | |
| 2 004 000 | OP CORPORATE BK 20-09/06/2030 FRN | EUR | 1 914 024 | 0,51 | | | | | |
| | <i>Portugal</i> | | <i>1 434 484</i> | <i>0,38</i> | | | | | |
| 1 600 000 | EDP SA 21-14/03/2082 FRN | EUR | 1 434 484 | 0,38 | | | | | |
| | <i>Japon</i> | | <i>1 344 842</i> | <i>0,36</i> | | | | | |
| 1 357 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCE 22-14/06/2025 FRN | EUR | 1 344 842 | 0,36 | | | | | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>1 227 049</i> | <i>0,33</i> | | | | | |
| 1 232 000 | DNB BANK ASA 22-21/09/2027 FRN | EUR | 1 227 049 | 0,33 | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>711 608</i> | <i>0,19</i> | | | | | |
| 710 000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 23-07/06/2025 FRN | EUR | 711 608 | 0,19 | | | | | |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 21 935 857 | 5,84 | | | | | |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>14 014 113</i> | <i>3,73</i> | | | | | |
| 42,00 | BNP PARIBAS FUNDS EURO CORPORATE GREEN BOND - X CAP | EUR | 4 618 743 | 1,23 | | | | | |
| 98,00 | BNP PARIBAS FUNDS SOCIAL BOND - X CAP | EUR | 9 395 370 | 2,50 | | | | | |
| | Total portefeuille-titres | | 378 029 849 | 100,54 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Euro Corporate Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|------------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>8 768 662</i> | <i>0,86</i> |
| 600 000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 23-21/09/2031 FRN | EUR | 633 599 | 0,06 |
| 1 500 000 | NATWEST GROUP 21-14/09/2032 FRN | EUR | 1 325 003 | 0,13 |
| 4 784 000 | NATWEST GROUP 22-06/09/2028 FRN | EUR | 4 866 678 | 0,48 |
| 800 000 | NATWEST GROUP 23-14/03/2028 FRN | EUR | 822 748 | 0,08 |
| 685 000 | NATWEST GROUP 23-16/02/2029 FRN | EUR | 711 889 | 0,07 |
| 100 000 | NATWEST GROUP 23-28/02/2034 FRN | EUR | 105 145 | 0,01 |
| 300 000 | PIRAEUS GRP FIN 19-26/06/2029 FRN | EUR | 303 600 | 0,03 |
| | <i>Danemark</i> | | <i>6 800 727</i> | <i>0,67</i> |
| 4 000 000 | JYSKE BANK A/S 21-02/09/2026 FRN | EUR | 3 754 932 | 0,37 |
| 1 000 000 | JYSKE BANK A/S 23-10/11/2029 FRN | EUR | 1 040 055 | 0,10 |
| 1 800 000 | ORSTED A/S 17-24/11/3017 FRN | EUR | 1 755 383 | 0,17 |
| 100 000 | ORSTED A/S 19-09/12/3019 FRN | EUR | 87 424 | 0,01 |
| 200 000 | ORSTED A/S 21-18/02/3021 FRN | EUR | 152 957 | 0,02 |
| 10 000 | ORSTED A/S 22-08/12/3022 FRN | EUR | 9 976 | 0,00 |
| | <i>Autriche</i> | | <i>3 005 830</i> | <i>0,29</i> |
| 400 000 | ERSTE GROUP 23-15/04/2172 FRN | EUR | 421 853 | 0,04 |
| 2 500 000 | ERSTE GROUP 23-16/01/2031 FRN | EUR | 2 583 977 | 0,25 |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>1 510 359</i> | <i>0,15</i> |
| 200 000 | BANK OF AMERICA CORP 19-22/10/2025 FRN | USD | 176 357 | 0,02 |
| 200 000 | GOLDMAN SACHS GROUP 19-31/12/2059 FRN | USD | 179 812 | 0,02 |
| 400 000 | GOLDMAN SACHS GROUP 21-12/02/2026 FRN | USD | 343 367 | 0,03 |
| 1 000 000 | MORGAN STANLEY 21-29/04/2033 FRN | EUR | 810 823 | 0,08 |
| | <i>Suède</i> | | <i>1 210 190</i> | <i>0,12</i> |
| 100 000 | SBAB BANK AB 23-26/06/2026 FRN | EUR | 100 972 | 0,01 |
| 900 000 | TELIA CO AB 20-11/05/2081 FRN | EUR | 834 292 | 0,08 |
| 300 000 | TELIA CO AB 22-30/06/2083 FRN | EUR | 274 926 | 0,03 |
| | <i>Finlande</i> | | <i>581 614</i> | <i>0,06</i> |
| 560 000 | NORDEA BANK ABP 23-23/02/2034 FRN | EUR | 581 614 | 0,06 |
| | <i>Pologne</i> | | <i>191 535</i> | <i>0,02</i> |
| 100 000 | MBANK 21-21/09/2027 FRN | EUR | 86 277 | 0,01 |
| 100 000 | MBANK 23-11/09/2027 FRN | EUR | 105 258 | 0,01 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 61 827 301 | 6,07 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>61 827 301</i> | <i>6,07</i> |
| 200,00 | BNP PARIBAS FUNDS EURO CORPORATE GREEN BOND - X CAP | EUR | 21 994 013 | 2,16 |
| 200,00 | BNP PARIBAS FUNDS SOCIAL BOND - X CAP | EUR | 19 174 223 | 1,88 |
| 145 825,78 | BNP PARIBAS INSTICASH EUR 1D - 1 CAP | EUR | 20 659 065 | 2,03 |
| | Total portefeuille-titres | | 996 645 420 | 98,29 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Euro Low Vol Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 40 766 542 | 99,83 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | <i>Finlande</i> | | | | |
| 27 785 | AXA SA | EUR | 819 380 | 2,01 | 18 943 | KONE OYJ - B | EUR | 855 465 | 2,10 |
| 5 719 | BUREAU VERITAS SA | EUR | 130 794 | 0,32 | 73 285 | NORDEA BANK ABP | EUR | 822 697 | 2,01 |
| 14 080 | DANONE | EUR | 826 214 | 2,02 | 23 905 | UPM-KYMMENE OYJ | EUR | 814 204 | 1,99 |
| 18 335 | DASSAULT SYSTEMES SE | EUR | 811 049 | 1,99 | <i>Belgique</i> | | | | |
| 7 837 | EDENRED | EUR | 424 295 | 1,04 | 2 286 | AGEAS | EUR | 89 863 | 0,22 |
| 4 335 | ESSILORLUXOTTICA | EUR | 787 236 | 1,93 | 10 473 | UCB SA | EUR | 826 320 | 2,02 |
| 7 395 | GECCINA SA | EUR | 814 190 | 1,99 | 28 654 | WAREHOUSES DE PAUW SCA | EUR | 816 639 | 2,00 |
| 48 221 | GETLINK SE | EUR | 798 781 | 1,96 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 408 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 782 870 | 1,92 | <i>France</i> | | | | |
| 8 624 | LEGRAND SA | EUR | 811 518 | 1,99 | 61,88 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 70 000 | 0,17 |
| 1 093 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 801 825 | 1,96 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 25 340 | MICHELIN (CGDE) | EUR | 822 536 | 2,01 | | | | 40 836 542 | 100,00 |
| 3 931 | PERNOD RICARD SA | EUR | 627 977 | 1,54 | | | | | |
| 9 164 | SANOFI AVENTIS | EUR | 822 561 | 2,01 | | | | | |
| 7 283 | SEB SA | EUR | 822 979 | 2,02 | | | | | |
| 7 193 | VINCI SA | EUR | 817 844 | 2,00 | | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 3 361 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 813 194 | 1,99 | | | | | |
| 8 078 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 814 101 | 1,99 | | | | | |
| 14 231 | BECHTLE AG | EUR | 645 945 | 1,58 | | | | | |
| 9 923 | BRENTAG AG | EUR | 825 792 | 2,02 | | | | | |
| 4 496 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 838 504 | 2,05 | | | | | |
| 44 422 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 821 807 | 2,01 | | | | | |
| 22 846 | GEA GROUP AG | EUR | 861 065 | 2,12 | | | | | |
| 3 780 | HANNOVER RUECK SE | EUR | 817 614 | 2,00 | | | | | |
| 12 710 | HENKEL AG & CO KGAA | EUR | 825 896 | 2,02 | | | | | |
| 4 575 | MERCK KGAA | EUR | 659 258 | 1,61 | | | | | |
| 2 146 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG - REG | EUR | 804 965 | 1,97 | | | | | |
| 5 769 | SAP SE | EUR | 804 660 | 1,97 | | | | | |
| 13 148 | SCOUT24 AG | EUR | 843 576 | 2,07 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 10 340 | AKZO NOBEL N.V. | EUR | 773 639 | 1,89 | | | | | |
| 19 049 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 813 392 | 1,99 | | | | | |
| 25 075 | FERROVIAL SE | EUR | 827 977 | 2,03 | | | | | |
| 5 117 | JDE PEETS NV | EUR | 124 650 | 0,31 | | | | | |
| 13 536 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | EUR | 352 139 | 0,86 | | | | | |
| 263 050 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 820 190 | 2,01 | | | | | |
| 22 975 | NN GROUP NV - W/I | EUR | 821 356 | 2,01 | | | | | |
| 20 949 | QIAGEN N.V. | EUR | 825 391 | 2,02 | | | | | |
| 14 237 | RANDSTAD HOLDING NV | EUR | 807 523 | 1,98 | | | | | |
| 6 273 | WOLTERS KLUWER | EUR | 807 335 | 1,98 | | | | | |
| <i>Espagne</i> | | | | | <i>Italie</i> | | | | |
| 20 710 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS | EUR | 831 714 | 2,04 | 42 466 | ASSICURAZIONI GENERALI | EUR | 811 313 | 1,99 |
| 12 396 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 804 252 | 1,97 | 16 981 | RECORDATI SPA | EUR | 829 182 | 2,03 |
| 51 016 | ENAGAS SA | EUR | 778 759 | 1,91 | 175 103 | SNAM SPA | EUR | 815 104 | 2,00 |
| 41 909 | ENDESA SA | EUR | 773 640 | 1,89 | 85 106 | TERNA SPA | EUR | 642 891 | 1,57 |
| 20 922 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | EUR | 824 954 | 2,02 | | | | | |
| 23 979 | RED ELECTRICA CORPORACION SA | EUR | 357 527 | 0,88 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Euro Multi-Factor Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 24 606 548 | 98,39 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | <i>8 746 224 34,95</i> | | | | |
| 22 929 | AXA SA | EUR | 676 176 | 2,70 | | | | | |
| 11 450 | BNP PARIBAS | EUR | 716 656 | 2,87 | | | | | |
| 5 384 | BOUYGUES SA | EUR | 183 702 | 0,73 | | | | | |
| 5 058 | BUREAU VERITAS SA | EUR | 115 676 | 0,46 | | | | | |
| 2 496 | CAPGEMINI SE | EUR | 471 120 | 1,88 | | | | | |
| 13 302 | CARREFOUR SA | EUR | 220 348 | 0,88 | | | | | |
| 8 113 | DANONE | EUR | 476 071 | 1,90 | | | | | |
| 1 459 | EIFPAGE SA | EUR | 141 552 | 0,57 | | | | | |
| 191 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 366 491 | 1,47 | | | | | |
| 634 | IPSEN | EUR | 68 409 | 0,27 | | | | | |
| 3 333 | LEGRAND SA | EUR | 313 635 | 1,25 | | | | | |
| 2 287 | LOREAL | EUR | 1 030 636 | 4,11 | | | | | |
| 408 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 299 309 | 1,20 | | | | | |
| 9 243 | MICHELIN (CGDE) | EUR | 300 028 | 1,20 | | | | | |
| 40 467 | ORANGE | EUR | 416 972 | 1,67 | | | | | |
| 857 | PERNOD RICARD SA | EUR | 136 906 | 0,55 | | | | | |
| 3 310 | PUBLICIS GROUPE | EUR | 278 040 | 1,11 | | | | | |
| 11 304 | SANOFI AVENTIS | EUR | 1 014 646 | 4,05 | | | | | |
| 14 080 | TOTAL SA | EUR | 867 327 | 3,47 | | | | | |
| 5 739 | VINCI SA | EUR | 652 524 | 2,61 | | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | <i>4 545 208 18,19</i> | | | | |
| 6 751 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 680 366 | 2,72 | | | | | |
| 1 283 | BECHTLE AG | EUR | 58 235 | 0,23 | | | | | |
| 54 | BEIERSDORF AG | EUR | 7 328 | 0,03 | | | | | |
| 2 581 | BRENTAG AG | EUR | 214 791 | 0,86 | | | | | |
| 40 482 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 880 483 | 3,52 | | | | | |
| 4 131 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG | EUR | 156 813 | 0,63 | | | | | |
| 2 766 | GEA GROUP AG | EUR | 104 251 | 0,42 | | | | | |
| 982 | HANNOVER RUECK SE | EUR | 212 407 | 0,85 | | | | | |
| 3 082 | HENKEL AG & CO KGAA VORZUG | EUR | 224 555 | 0,90 | | | | | |
| 9 762 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | EUR | 369 004 | 1,48 | | | | | |
| 12 276 | MERCEDES BENZ GROUP AG | EUR | 767 864 | 3,07 | | | | | |
| 2 053 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG - REG | EUR | 770 080 | 3,08 | | | | | |
| 710 | SAP SE | EUR | 99 031 | 0,40 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | <i>4 051 849 16,19</i> | | | | |
| 2 673 | ASML HOLDING NV | EUR | 1 822 183 | 7,28 | | | | | |
| 4 925 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 210 298 | 0,84 | | | | | |
| 35 | HEINEKEN NV | EUR | 3 218 | 0,01 | | | | | |
| 16 172 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | EUR | 420 715 | 1,68 | | | | | |
| 84 435 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 263 268 | 1,05 | | | | | |
| 34 417 | STELLANTIS NV | EUR | 727 920 | 2,91 | | | | | |
| 4 695 | WOLTERS KLUWER | EUR | 604 247 | 2,42 | | | | | |
| <i>Espagne</i> | | | | | <i>3 200 708 12,81</i> | | | | |
| 3 916 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS | EUR | 157 267 | 0,63 | | | | | |
| 1 051 | AENA SA | EUR | 172 469 | 0,69 | | | | | |
| 5 072 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 329 071 | 1,32 | | | | | |
| 7 106 | ENAGAS SA | EUR | 108 473 | 0,43 | | | | | |
| 10 636 | ENDESA SA | EUR | 196 341 | 0,79 | | | | | |
| 72 381 | IBERDROLA SA | EUR | 859 162 | 3,44 | | | | | |
| 18 126 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | EUR | 714 708 | 2,86 | | | | | |
| 8 764 | RED ELECTRICA CORPORACION SA | EUR | 130 671 | 0,52 | | | | | |
| 150 692 | TELEFONICA SA | EUR | 532 546 | 2,13 | | | | | |
| | | | | | <i>Italie</i> | | | | |
| 23 571 | ASSICURAZIONI GENERALI | EUR | 450 324 | 1,80 | 2 098 125 | | | 8,39 | |
| 78 527 | ENEL SPA | EUR | 528 487 | 2,11 | 450 324 | | | 1,80 | |
| 265 366 | INTESA SANPAOLO | EUR | 701 495 | 2,81 | 528 487 | | | 2,11 | |
| 14 964 | POSTE ITALIANE SPA | EUR | 153 755 | 0,61 | 701 495 | | | 2,81 | |
| 6 414 | PRYSMIAN SPA | EUR | 264 064 | 1,06 | 153 755 | | | 0,61 | |
| | | | | | <i>Irlande</i> | | | | |
| 31 782 | AIB GROUP PLC | EUR | 123 314 | 0,49 | 493 657 | | | 1,97 | |
| 14 847 | BANK OF IRELAND GROUP PLC | EUR | 122 013 | 0,49 | 123 314 | | | 0,49 | |
| 3 157 | KERRY GROUP PLC - A | EUR | 248 330 | 0,99 | 122 013 | | | 0,49 | |
| | | | | | <i>Suisse</i> | | | | |
| 10 807 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 488 584 | 1,95 | 488 584 | | | 1,95 | |
| | | | | | <i>Belgique</i> | | | | |
| 2 655 | AGEAS | EUR | 104 368 | 0,42 | 411 356 | | | 1,65 | |
| 5 228 | KBC GROEP NV | EUR | 306 988 | 1,23 | 104 368 | | | 0,42 | |
| | | | | | <i>Portugal</i> | | | | |
| 15 778 | GALP ENERGIA SGPS SA | EUR | 210 479 | 0,84 | 324 873 | | | 1,30 | |
| 4 965 | JERONIMO MARTINS | EUR | 114 394 | 0,46 | 210 479 | | | 0,84 | |
| | | | | | <i>Finlande</i> | | | | |
| 11 973 | FORTUM OYJ | EUR | 156 367 | 0,63 | 156 367 | | | 0,63 | |
| | | | | | <i>Autriche</i> | | | | |
| 1 066 | VERBUND AG | EUR | 89 597 | 0,36 | 89 597 | | | 0,36 | |
| | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| | | | | | 60 014 0,24 | | | | |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 53,05 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 60 014 | 0,24 | 60 014 | | | 0,24 | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | | | 24 666 562 98,63 | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Europe Dividend

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | | | 134 357 696 99,70 | | | | |
| <i>France</i> | | | | | <i>48 444 592 35,95</i> | | | | |
| 45 851 | ACCOR SA | EUR | 1 586 445 | 1,18 | 413 066 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 1 287 940 | 0,96 |
| 23 312 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 4 105 709 | 3,05 | 70 254 | SHELL PLC | EUR | 2 093 569 | 1,55 |
| 29 534 | AMUNDI SA | EUR | 1 819 294 | 1,35 | 40 192 | STELLANTIS NV | EUR | 850 061 | 0,63 |
| 7 809 | ARKEMA | EUR | 804 327 | 0,60 | 6 339 | WOLTERS KLUWER | EUR | 815 829 | 0,61 |
| 107 168 | AXA SA | EUR | 3 160 384 | 2,35 | <i>Royaume-Uni</i> | | | | |
| 58 403 | BNP PARIBAS | EUR | 3 655 444 | 2,71 | 25 901 | ANGLO AMERICAN PLC | GBP | 589 008 | 0,44 |
| 20 317 | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | EUR | 1 354 331 | 1,00 | 31 163 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 3 811 988 | 2,83 |
| 53 070 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 682 056 | 0,51 | 44 234 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 1 095 449 | 0,81 |
| 17 034 | DANONE | EUR | 999 555 | 0,74 | 8 963 | CRODA INTERNATIONAL PLC | GBP | 522 337 | 0,39 |
| 8 444 | ESSILORLUXOTTICA | EUR | 1 533 430 | 1,14 | 46 285 | GSK PLC | GBP | 774 595 | 0,57 |
| 38 943 | FAURECIA | EUR | 795 216 | 0,59 | 178 465 | INFORMA PLC | GBP | 1 608 873 | 1,19 |
| 9 865 | LEGRAND SA | EUR | 928 297 | 0,69 | 1 043 561 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | GBP | 574 558 | 0,43 |
| 9 099 | LOREAL | EUR | 4 100 464 | 3,04 | 73 596 | RELX PLC | GBP | 2 641 320 | 1,96 |
| 7 191 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | EUR | 5 275 317 | 3,91 | 335 512 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 569 350 | 0,42 |
| 43 600 | MICHELIN (CGDE) | EUR | 1 415 256 | 1,05 | <i>Italie</i> | | | | |
| 6 979 | NEXANS SA | EUR | 553 086 | 0,41 | 55 354 | ASSICURAZIONI GENERALI | EUR | 1 057 538 | 0,78 |
| 3 276 | PERNOD RICARD SA | EUR | 523 341 | 0,39 | 367 309 | ENEL SPA | EUR | 2 471 990 | 1,83 |
| 11 772 | PUBLICIS GROUPE | EUR | 988 848 | 0,73 | 119 269 | ENI S.P.A. | EUR | 1 830 541 | 1,36 |
| 17 010 | SANOFI AVENTIS | EUR | 1 526 818 | 1,13 | 560 107 | INTESA SANPAOLO | EUR | 1 480 643 | 1,10 |
| 19 060 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 3 464 727 | 2,57 | 77 415 | UNICREDIT SPA | EUR | 1 901 699 | 1,41 |
| 66 332 | SPIE SA - W/I | EUR | 1 877 196 | 1,39 | <i>Danemark</i> | | | | |
| 38 854 | TECHNIP ENERGIES NV | EUR | 822 151 | 0,61 | 61 098 | NOVO NORDISK A/S-B | DKK | 5 721 674 | 4,26 |
| 48 741 | TOTAL SA | EUR | 3 002 446 | 2,23 | <i>Espagne</i> | | | | |
| 43 232 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 1 234 706 | 0,92 | 391 922 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 1 481 269 | 1,10 |
| 15 009 | VINCI SA | EUR | 1 706 523 | 1,27 | 40 340 | EDP RENOVAVEIS SA | EUR | 747 299 | 0,55 |
| 6 562 | WENDEL | EUR | 529 225 | 0,39 | 170 614 | IBERDROLA SA | EUR | 2 025 188 | 1,50 |
| <i>Allemagne</i> | | | | | <i>Belgique</i> | | | | |
| 5 311 | ADIDAS AG | EUR | 978 074 | 0,73 | 47 776 | WAREHOUSES DE PAUW SCA | EUR | 1 361 616 | 1,01 |
| 13 598 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 3 290 036 | 2,44 | <i>Suède</i> | | | | |
| 6 276 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 632 495 | 0,47 | 54 453 | ATLAS COPCO AB-A | SEK | 848 895 | 0,63 |
| 15 429 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 692 068 | 0,51 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 160 398 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 3 488 657 | 2,59 | 386 248 0,29 | | | | |
| 17 627 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | EUR | 666 301 | 0,49 | <i>France</i> | | | | |
| 11 292 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 895 681 | 0,66 | 16,41 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 386 248 | 0,29 |
| 12 401 | MERCK KGAA | EUR | 1 786 984 | 1,33 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 24 617 | SAP SE | EUR | 3 433 579 | 2,55 | 134 743 944 99,99 | | | | |
| 18 373 | SIEMENS AG - REG | EUR | 3 121 940 | 2,32 | | | | | |
| 28 033 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 1 474 536 | 1,09 | | | | | |
| 3 967 | SYMRISE AG | EUR | 395 272 | 0,29 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | <i>19 034 537 14,13</i> | | | | |
| 21 290 | CIE FINANCIERE RICHEMONT - REG | CHF | 2 650 659 | 1,97 | | | | | |
| 10 467 | DSM-FIRMENICH AG | EUR | 962 964 | 0,71 | | | | | |
| 44 057 | NESTLE SA-REG | CHF | 4 620 842 | 3,43 | | | | | |
| 54 873 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 5 009 219 | 3,72 | | | | | |
| 4 045 | ROCHE HOLDING AG GENUSSSCHEIN | CHF | 1 063 787 | 0,79 | | | | | |
| 2 964 | SIKA AG - REG | CHF | 872 590 | 0,65 | | | | | |
| 35 965 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 1 625 978 | 1,21 | | | | | |
| 4 713 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 2 228 498 | 1,65 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | <i>12 907 114 9,58</i> | | | | |
| 2 293 | ASM INTERNATIONAL NV | EUR | 1 077 595 | 0,80 | | | | | |
| 5 462 | ASML HOLDING NV | EUR | 3 723 445 | 2,76 | | | | | |
| 10 919 | HEINEKEN NV | EUR | 1 003 893 | 0,74 | | | | | |
| 65 425 | ING GROEP NV | EUR | 884 939 | 0,66 | | | | | |
| 44 968 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | EUR | 1 169 843 | 0,87 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Europe Multi-Factor Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Autriche</i> | | <i>1 085 422</i> | <i>0,33</i> |
| 12 914 | VERBUND AG | EUR | 1 085 422 | 0,33 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 800 197 | 0,25 |
| | <i>France</i> | | <i>800 197</i> | <i>0,25</i> |
| 707,36 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 800 197 | 0,25 |
| | Total portefeuille-titres | | 321 430 656 | 98,89 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Europe Value

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|---------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 416 096 626 | 99,31 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 113 093 | AMUNDI SA | EUR | 6 966 529 | 1,66 | | | | | |
| 72 572 | ARKEMA | EUR | 7 474 916 | 1,78 | | | | | |
| 451 327 | AXA SA | EUR | 13 309 633 | 3,18 | | | | | |
| 254 920 | BNP PARIBAS | EUR | 15 955 443 | 3,80 | | | | | |
| 131 539 | COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN | EUR | 8 768 390 | 2,09 | | | | | |
| 123 626 | DANONE | EUR | 7 254 374 | 1,73 | | | | | |
| 218 759 | ENGIE | EUR | 3 482 206 | 0,83 | | | | | |
| 135 848 | FAURECIA | EUR | 2 774 016 | 0,66 | | | | | |
| 17 002 | IPSEN | EUR | 1 834 516 | 0,44 | | | | | |
| 92 560 | RENAULT SA | EUR | 3 415 927 | 0,82 | | | | | |
| 102 948 | SANOFI AVENTIS | EUR | 9 240 612 | 2,21 | | | | | |
| 207 669 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 4 989 248 | 1,19 | | | | | |
| 112 637 | SPIE SA - W/I | EUR | 3 187 627 | 0,76 | | | | | |
| 169 958 | TECHNIP ENERGIES NV | EUR | 3 596 311 | 0,86 | | | | | |
| 217 837 | TOTAL SA | EUR | 13 418 759 | 3,20 | | | | | |
| 224 707 | VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 6 417 632 | 1,53 | | | | | |
| 84 272 | VINCI SA | EUR | 9 581 726 | 2,29 | | | | | |
| 21 182 | WENDEL | EUR | 1 708 328 | 0,41 | | | | | |
| <i>Allemagne</i> | | | | | | | | | |
| 70 683 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 17 101 752 | 4,07 | | | | | |
| 43 684 | BASF SE | EUR | 2 130 906 | 0,51 | | | | | |
| 76 458 | BAYER AG - REG | EUR | 2 571 283 | 0,61 | | | | | |
| 26 915 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 2 712 494 | 0,65 | | | | | |
| 86 352 | COVESTRO AG | EUR | 4 549 023 | 1,09 | | | | | |
| 88 407 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 3 965 496 | 0,95 | | | | | |
| 616 959 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 13 418 858 | 3,20 | | | | | |
| 324 711 | E.ON SE | EUR | 3 945 239 | 0,94 | | | | | |
| 209 565 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 3 876 953 | 0,93 | | | | | |
| 83 921 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | EUR | 3 172 214 | 0,76 | | | | | |
| 95 070 | KION GROUP AG | EUR | 3 676 357 | 0,88 | | | | | |
| 58 667 | LEG IMMOBILIE SE | EUR | 4 653 466 | 1,11 | | | | | |
| 39 361 | MERCK KGAA | EUR | 5 671 920 | 1,35 | | | | | |
| 30 007 | SAP SE | EUR | 4 185 376 | 1,00 | | | | | |
| 93 541 | SIEMENS AG - REG | EUR | 15 894 487 | 3,79 | | | | | |
| 214 174 | VONOVIA SE | EUR | 6 112 526 | 1,46 | | | | | |
| <i>Suisse</i> | | | | | | | | | |
| 49 389 | NESTLE SA-REG | CHF | 5 180 081 | 1,24 | | | | | |
| 272 192 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 24 847 730 | 5,92 | | | | | |
| 36 562 | ROCHE HOLDING AG GENUSSSCHEIN | CHF | 9 615 369 | 2,29 | | | | | |
| 105 889 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 4 787 242 | 1,14 | | | | | |
| 18 064 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 8 541 394 | 2,04 | | | | | |
| <i>Italie</i> | | | | | | | | | |
| 284 555 | ASSICURAZIONI GENERALI | EUR | 5 436 423 | 1,30 | | | | | |
| 1 930 795 | ENEL SPA | EUR | 12 994 250 | 3,10 | | | | | |
| 488 080 | ENI S.P.A. | EUR | 7 491 052 | 1,79 | | | | | |
| 4 150 423 | INTESA SANPAOLO | EUR | 10 971 643 | 2,62 | | | | | |
| 271 038 | UNICREDIT SPA | EUR | 6 658 048 | 1,59 | | | | | |
| <i>Pays-Bas</i> | | | | | | | | | |
| 64 282 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 2 744 841 | 0,66 | | | | | |
| 214 892 | ING GROEP NV | EUR | 2 906 629 | 0,69 | | | | | |
| 167 337 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | EUR | 4 353 272 | 1,04 | | | | | |
| 1 916 694 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 5 976 252 | 1,43 | | | | | |
| 395 724 | SHELL PLC | GBP | 11 743 169 | 2,80 | | | | | |
| 388 459 | STELLANTIS NV | EUR | 8 215 908 | 1,96 | | | | | |
| | | | | | <i>Espagne</i> | | | | |
| 538 301 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA | EUR | 4 428 064 | 1,06 | | | | | |
| 4 053 416 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 15 319 886 | 3,66 | | | | | |
| 1 002 634 | IBERDROLA SA | EUR | 11 901 266 | 2,84 | | | | | |
| | | | | | <i>Royaume-Uni</i> | | | | |
| 243 427 | ANGLO AMERICAN PLC | GBP | 5 535 713 | 1,32 | | | | | |
| 34 128 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 4 174 679 | 1,00 | | | | | |
| 11 227 839 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | GBP | 6 181 758 | 1,48 | | | | | |
| 1 009 212 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 1 712 592 | 0,41 | | | | | |
| | | | | | <i>Norvège</i> | | | | |
| 1 118 282 | NORSK HYDRO ASA | NOK | 6 818 246 | 1,63 | | | | | |
| | | | | | <i>Finlande</i> | | | | |
| 341 694 | STORA ENSO OYJ - R | EUR | 4 279 717 | 1,02 | | | | | |
| | | | | | <i>Belgique</i> | | | | |
| 24 049 | SYENSO SA | EUR | 2 266 859 | 0,54 | | | | | |
| | | | | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| | | | | | <i>France</i> | | | | |
| 174,19 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 4 100 722 | 0,98 | | | | | |
| | | | | | Total portefeuille-titres | | | | |
| | | | 420 197 348 | 100,29 | | | | | |

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 9 052 017 | 2,37 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>9 052 017</i> | <i>2,37</i> |
| 70,00 | BNP PARIBAS FUNDS EURO CORPORATE GREEN BOND - X CAP | EUR | 8 503 490 | 2,23 |
| 3 215,29 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV - 1CAP | USD | 548 527 | 0,14 |
| | Total portefeuille-titres | | 367 143 148 | 96,50 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Global Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 335 355 698 | 99,03 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 8 435 | ADOBE INC | USD | 5 032 321 | 1,49 | 117 642 | EXPERIAN PLC | GBP | 4 801 919 | 1,42 |
| 77 788 | ALPHABET INC - A | USD | 10 866 205 | 3,21 | 27 298 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | USD | 3 357 654 | 0,99 |
| 65 551 | AMAZON.COM INC | USD | 9 959 819 | 2,94 | <i>Taiwan</i> | | | | |
| 76 586 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | USD | 5 188 702 | 1,53 | 340 000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 6 562 396 | 1,94 |
| 94 396 | APPLE INC | USD | 18 174 061 | 5,36 | <i>Suisse</i> | | | | |
| 148 781 | BAKER HUGHES CO | USD | 5 085 335 | 1,50 | 92 974 | COCA-COLA HBC AG-DI | GBP | 2 731 892 | 0,81 |
| 165 872 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 5 584 910 | 1,65 | 71 869 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 3 592 005 | 1,06 |
| 7 558 | BLACKROCK INC | USD | 6 135 584 | 1,81 | <i>Espagne</i> | | | | |
| 95 146 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 5 500 390 | 1,62 | 438 546 | IBERDROLA SA | EUR | 5 750 301 | 1,70 |
| 100 180 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 5 140 236 | 1,52 | <i>Chine</i> | | | | |
| 95 076 | COMCAST CORP - A | USD | 4 169 083 | 1,23 | 143 000 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 5 398 532 | 1,59 |
| 128 269 | CORPORATE OFFICE PROPERTIES | USD | 3 287 534 | 0,97 | <i>Inde</i> | | | | |
| 9 212 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 6 080 657 | 1,80 | 257 019 | HDFC BANK LIMITED | INR | 5 275 991 | 1,56 |
| 11 514 | ELI LILLY & CO | USD | 6 711 741 | 1,98 | <i>Singapour</i> | | | | |
| 21 860 | FIRST SOLAR INC | USD | 3 766 041 | 1,11 | 195 700 | DBS GROUP HOLDINGS LTD | SGD | 4 954 621 | 1,46 |
| 41 256 | GENERAL ELECTRIC CO | USD | 5 265 503 | 1,55 | <i>Norvège</i> | | | | |
| 127 040 | GENERAL MOTORS CO | USD | 4 563 277 | 1,35 | 136 875 | EQUINOR ASA | NOK | 4 341 824 | 1,28 |
| 35 181 | ITT INC | USD | 4 197 797 | 1,24 | <i>Corée du Sud</i> | | | | |
| 47 363 | MICROSOFT CORP | USD | 17 810 382 | 5,25 | 30 997 | SK HYNIX INC | KRW | 3 403 673 | 1,01 |
| 22 028 | NIKE INC - B | USD | 2 391 580 | 0,71 | <i>Argentine</i> | | | | |
| 18 090 | NVIDIA CORP | USD | 8 958 530 | 2,65 | 136 070 | ARCOS DORADOS HOLDINGS INC - A | USD | 1 726 728 | 0,51 |
| 17 927 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 5 286 314 | 1,56 | Autres valeurs mobilières | | | | |
| 24 526 | SALESFORCE.COM INC | USD | 6 453 772 | 1,91 | | | | | |
| 22 764 | SBA COMMUNICATIONS CORP | USD | 5 774 999 | 1,71 | Actions | | | | |
| 52 103 | TJX COMPANIES INC | USD | 4 887 782 | 1,44 | <i>Chine</i> | | | | |
| 11 974 | TOPBUILD CORP | USD | 4 481 389 | 1,32 | 1 522 104 | CHINA ANIMAL HEALTHCARE LTD | HKD | 0 | 0,00 |
| 19 495 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 4 754 831 | 1,40 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 22 482 | UNION PACIFIC CORP | USD | 5 522 029 | 1,63 | | | | | |
| 14 093 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 7 419 542 | 2,19 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 14 032 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 5 709 480 | 1,69 | 11 379,92 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV - I CAP | USD | 1 941 408 | 0,57 |
| 27 851 | VISA INC - A | USD | 7 251 008 | 2,14 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 49 155 | WALT DISNEY CO | USD | 4 438 205 | 1,31 | 337 297 106 | | | | |
| 30 927 | WASTE CONNECTIONS INC | USD | 4 616 473 | 1,36 | 99,60 | | | | |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | | | | | | | |
| 241 354 | ANTOFAGASTA PLC | GBP | 5 167 323 | 1,53 | | | | | |
| 42 970 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 5 806 338 | 1,71 | | | | | |
| 1 214 015 | JD SPORTS FASHION PLC | GBP | 2 568 221 | 0,76 | | | | | |
| 16 497 | LINDE PLC | USD | 6 775 483 | 2,00 | | | | | |
| 1 672 416 | NATWEST GROUP PLC | GBP | 4 677 481 | 1,38 | | | | | |
| <i>Japon</i> | | | | | | | | | |
| 73 000 | HITACHI LTD | JPY | 5 274 830 | 1,56 | | | | | |
| 90 200 | KDDI CORP | JPY | 2 871 933 | 0,85 | | | | | |
| 589 400 | mitsubishi UFJ FINANCIAL GROUP | JPY | 5 065 188 | 1,50 | | | | | |
| 59 100 | SONY CORP | JPY | 5 620 567 | 1,66 | | | | | |
| 256 900 | TOYOTA MOTOR CORP | JPY | 4 734 026 | 1,40 | | | | | |
| <i>France</i> | | | | | | | | | |
| 75 258 | DANONE | EUR | 4 878 288 | 1,44 | | | | | |
| 11 099 | LOREAL | EUR | 5 525 199 | 1,63 | | | | | |
| 65 024 | TOTAL SA | EUR | 4 424 652 | 1,31 | | | | | |
| <i>Italie</i> | | | | | | | | | |
| 731 782 | ENEL SPA | EUR | 5 440 283 | 1,61 | | | | | |
| 153 408 | UNICREDIT SPA | EUR | 4 162 838 | 1,23 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Global Low Vol Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|-----------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | <i>Hong-Kong</i> | | <i>3 048 036</i> | <i>0,40</i> |
| 619 000 | HKT TRUST AND HKT LTD | HKD | 669 382 | 0,09 |
| 516 000 | MTR CORP | HKD | 1 815 005 | 0,24 |
| 572 000 | SINO LAND CO | HKD | 563 649 | 0,07 |
| | <i>Nouvelle-Zélande</i> | | <i>2 513 239</i> | <i>0,33</i> |
| 250 263 | AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD | NZD | 1 262 366 | 0,17 |
| 19 088 | EBOS GROUP LTD | NZD | 388 320 | 0,05 |
| 290 512 | SPARK NEW ZEALAND LTD | NZD | 862 553 | 0,11 |
| | <i>Belgique</i> | | <i>2 401 538</i> | <i>0,32</i> |
| 33 720 | GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | EUR | 2 401 538 | 0,32 |
| | <i>Suède</i> | | <i>2 307 551</i> | <i>0,31</i> |
| 170 012 | SVENSKA CELLULOSA AB SCA - B | SEK | 2 307 551 | 0,31 |
| | <i>Norvège</i> | | <i>2 034 670</i> | <i>0,27</i> |
| 49 187 | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | NOK | 822 085 | 0,11 |
| 126 904 | ORKLA ASA | NOK | 891 840 | 0,12 |
| 9 962 | YARA INTERNATIONAL ASA | NOK | 320 745 | 0,04 |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 11 419 031 | 1,52 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>9 918 663</i> | <i>1,32</i> |
| 51 775,12 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE GLOBAL MULTI FACTOR EQUITY - X CAP | USD | 9 918 663 | 1,32 |
| | <i>France</i> | | <i>1 500 368</i> | <i>0,20</i> |
| 1 326,31 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 1 500 368 | 0,20 |
| | Total portefeuille-titres | | 750 632 782 | 99,72 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | |
|----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|---|--|---------------------|-------------------|------|
| | <i>Irlande</i> | | <i>744 054</i> | <i>1,25</i> | | <i>Portugal</i> | | <i>537 364</i> | <i>0,90</i> | |
| 220 000 | ATLAS COPCO FIN 0,750% 22-08/02/2032 | EUR | 203 844 | 0,34 | 200 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 21-07/04/2028 FRN | EUR | 206 161 | 0,35 | |
| 210 000 | EXPERIAN EUROPE 1,560% 22-16/05/2031 | EUR | 208 586 | 0,35 | 100 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 21-12/02/2027 FRN | EUR | 104 324 | 0,17 | |
| 320 000 | TRANE TECH 5,250% 23-03/03/2033 | USD | 331 624 | 0,56 | 200 000 | BANCO COMMERCIAL PORTUGUES 23-02/10/2026 FRN | EUR | 226 879 | 0,38 | |
| | <i>Japon</i> | | <i>741 187</i> | <i>1,24</i> | | <i>Italie</i> | | <i>408 748</i> | <i>0,68</i> | |
| 320 000 | NTT FINANCE 1,162% 21-03/04/2026 | USD | 296 117 | 0,50 | 210 000 | INTESA SANPAOLO 23-20/06/2054 FRN | USD | 216 767 | 0,36 | |
| 450 000 | NTT FINANCE 4,239% 22-25/07/2025 | USD | 445 070 | 0,74 | 170 000 | UNICREDIT SPA 23-16/02/2029 FRN | EUR | 191 981 | 0,32 | |
| | <i>Suède</i> | | <i>520 971</i> | <i>0,88</i> | | <i>Danemark</i> | | <i>329 081</i> | <i>0,55</i> | |
| 240 000 | AUTOLIV INC 4,250% 23-15/03/2028 | EUR | 271 816 | 0,46 | 340 000 | DANSKE BANK A/S 22-01/04/2028 FRN | USD | 329 081 | 0,55 | |
| 120 000 | ERICSSON LM 1,125% 22-08/02/2027 | EUR | 122 368 | 0,21 | | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 401 075 | 0,67 | |
| 120 000 | TELE2 AB 2,125% 18-15/05/2028 | EUR | 126 787 | 0,21 | | <i>Luxembourg</i> | | <i>401 075</i> | <i>0,67</i> | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>454 918</i> | <i>0,75</i> | | 2 350,98 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV - I CAP | USD | 401 075 | 0,67 |
| 490 000 | DNB BANK ASA 1,127% 20-16/09/2026 | USD | 454 918 | 0,75 | | Total portefeuille-titres | | 58 078 976 | 97,38 | |
| | <i>Australie</i> | | <i>283 880</i> | <i>0,47</i> | | | | | | |
| 120 000 | SCENTRE GROUP TR 1,750% 18-11/04/2028 | EUR | 120 663 | 0,20 | | | | | | |
| 160 000 | TELSTRA CORP LTD 1,375% 19-26/03/2029 | EUR | 163 217 | 0,27 | | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>269 066</i> | <i>0,45</i> | | | | | | |
| 200 000 | GECINA 0,875% 21-30/06/2036 | EUR | 162 775 | 0,27 | | | | | | |
| 100 000 | LEGRAND SA 1,000% 18-06/03/2026 | EUR | 106 291 | 0,18 | | | | | | |
| | <i>Autriche</i> | | <i>233 680</i> | <i>0,39</i> | | | | | | |
| 200 000 | A1 TOWERS HLDG 5,250% 23-13/07/2028 | EUR | 233 680 | 0,39 | | | | | | |
| | Obligations à taux flottant | | 7 403 944 | 12,41 | | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>2 210 144</i> | <i>3,72</i> | | | | | | |
| 260 000 | AIB GROUP PLC 22-14/10/2026 FRN | USD | 268 588 | 0,45 | | | | | | |
| 230 000 | AIB GROUP PLC 22-16/02/2029 FRN | EUR | 272 945 | 0,46 | | | | | | |
| 140 000 | AIB GROUP PLC 23/07/2029 FRN | EUR | 159 406 | 0,27 | | | | | | |
| 310 000 | AIB GROUP PLC 23-13/09/2029 FRN | USD | 326 612 | 0,55 | | | | | | |
| 260 000 | BANK OF IRELAND 21-30/09/2027 FRN | USD | 237 966 | 0,40 | | | | | | |
| 250 000 | BANK OF IRELAND 22-05/06/2026 FRN | EUR | 268 502 | 0,45 | | | | | | |
| 270 000 | BANK OF IRELAND 22-16/09/2026 FRN | USD | 273 343 | 0,46 | | | | | | |
| 180 000 | BANK OF IRELAND 23-13/11/2029 FRN | EUR | 206 516 | 0,35 | | | | | | |
| 170 000 | BANK OF IRELAND 23-16/07/2028 FRN | EUR | 196 266 | 0,33 | | | | | | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | <i>1 419 046</i> | <i>2,38</i> | | | | | | |
| 250 000 | HSBC HOLDINGS 17-13/03/2028 FRN | USD | 240 922 | 0,40 | | | | | | |
| 330 000 | HSBC HOLDINGS 18-12/09/2026 FRN | USD | 323 052 | 0,54 | | | | | | |
| 260 000 | HSBC HOLDINGS 20-04/06/2026 FRN | USD | 247 722 | 0,42 | | | | | | |
| 180 000 | HSBC HOLDINGS 21-24/09/2029 FRN | EUR | 174 371 | 0,29 | | | | | | |
| 250 000 | HSBC HOLDINGS 22-15/06/2027 FRN | EUR | 272 658 | 0,46 | | | | | | |
| 140 000 | HSBC HOLDINGS 23-10/03/2028 FRN | EUR | 160 321 | 0,27 | | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>1 248 489</i> | <i>2,09</i> | | | | | | |
| 200 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 22-14/01/2029 FRN | EUR | 200 323 | 0,34 | | | | | | |
| 400 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 22-14/09/2026 FRN | USD | 402 112 | 0,67 | | | | | | |
| 400 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 22-14/09/2028 FRN | USD | 410 181 | 0,68 | | | | | | |
| 200 000 | CAIXABANK 23-19/07/2034 FRN | EUR | 235 873 | 0,40 | | | | | | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>661 330</i> | <i>1,09</i> | | | | | | |
| 500 000 | DNB BANK ASA 21-25/05/2027 FRN | USD | 456 031 | 0,75 | | | | | | |
| 230 000 | DNB BANK ASA 21-30/03/2028 FRN | USD | 205 299 | 0,34 | | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>589 742</i> | <i>1,00</i> | | | | | | |
| 200 000 | JPMORGAN CHASE 18-12/06/2029 FRN | EUR | 206 529 | 0,35 | | | | | | |
| 190 000 | JPMORGAN CHASE 20-22/04/2026 FRN | USD | 182 056 | 0,31 | | | | | | |
| 200 000 | JPMORGAN CHASE 20-24/02/2028 FRN | EUR | 201 157 | 0,34 | | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Global Multi-Factor Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|----------|---|--------------------|---------------------|-------------------|----------|--------------|--------------------|---------------------|-------------------|
| 1 000 | NEC CORP | JPY | 59 281 | 0,20 | | | | | |
| 204 300 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE | JPY | 249 828 | 0,83 | | | | | |
| 2 200 | RENESAS ELECTRONICS CORP | JPY | 39 838 | 0,13 | | | | | |
| 13 900 | SOFTBANK CORP | JPY | 173 489 | 0,58 | | | | | |
| 3 400 | SUBARU CORP | JPY | 62 531 | 0,21 | | | | | |
| 2 200 | TOYOTA MOTOR CORP | JPY | 40 541 | 0,13 | | | | | |
| | <i>Allemagne</i> | | <i>982 343</i> | <i>3,26</i> | | | | | |
| 2 840 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 316 168 | 1,05 | | | | | |
| 14 189 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 340 907 | 1,13 | | | | | |
| 785 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG - REG | EUR | 325 268 | 1,08 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | <i>852 060</i> | <i>2,84</i> | | | | | |
| 10 762 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE | EUR | 309 273 | 1,03 | | | | | |
| 83 377 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 287 175 | 0,96 | | | | | |
| 3 055 | SHELL PLC | GBP | 100 145 | 0,33 | | | | | |
| 770 | STELLANTIS NV | EUR | 17 990 | 0,06 | | | | | |
| 967 | WOLTERS KLUWER | EUR | 137 477 | 0,46 | | | | | |
| | <i>Singapour</i> | | <i>842 820</i> | <i>2,80</i> | | | | | |
| 13 300 | DBS GROUP HOLDINGS LTD | SGD | 336 722 | 1,12 | | | | | |
| 33 300 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | SGD | 328 121 | 1,09 | | | | | |
| 35 800 | SINGAPORE AIRLINES LTD | SGD | 177 977 | 0,59 | | | | | |
| | <i>Suisse</i> | | <i>768 781</i> | <i>2,56</i> | | | | | |
| 3 383 | COCA-COLA HBC AG-DI | GBP | 99 404 | 0,33 | | | | | |
| 4 028 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 406 187 | 1,35 | | | | | |
| 587 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 29 316 | 0,10 | | | | | |
| 389 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 233 874 | 0,78 | | | | | |
| | <i>France</i> | | <i>684 693</i> | <i>2,27</i> | | | | | |
| 836 | EIFFAGE SA | EUR | 89 597 | 0,30 | | | | | |
| 742 | IPSEN | EUR | 88 440 | 0,29 | | | | | |
| 5 761 | ORANGE | EUR | 65 574 | 0,22 | | | | | |
| 2 047 | PUBLICIS GROUPE | EUR | 189 942 | 0,63 | | | | | |
| 1 104 | SANOFI AVENTIS | EUR | 109 465 | 0,36 | | | | | |
| 1 128 | VINCI SA | EUR | 141 675 | 0,47 | | | | | |
| | <i>Bermudes</i> | | <i>602 809</i> | <i>2,00</i> | | | | | |
| 4 146 | ARCH CAPITAL GROUP LTD | USD | 307 923 | 1,02 | | | | | |
| 834 | EVEREST RE GROUP LTD | USD | 294 886 | 0,98 | | | | | |
| | <i>Australie</i> | | <i>591 117</i> | <i>1,97</i> | | | | | |
| 34 203 | BRAMBLES LTD | AUD | 317 401 | 1,06 | | | | | |
| 15 628 | QANTAS AIRWAYS LTD | AUD | 57 339 | 0,19 | | | | | |
| 80 017 | TELSTRA GROUP LTD | AUD | 216 377 | 0,72 | | | | | |
| | <i>Irlande</i> | | <i>413 021</i> | <i>1,37</i> | | | | | |
| 1 177 | ACCENTURE PLC - A | USD | 413 021 | 1,37 | | | | | |
| | <i>Espagne</i> | | <i>195 418</i> | <i>0,65</i> | | | | | |
| 2 201 | ACS ACTIVIDADES DE CONSTRUCCION Y SERVICIOS | EUR | 97 642 | 0,32 | | | | | |
| 1 291 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL | EUR | 56 231 | 0,19 | | | | | |
| 10 642 | TELEFONICA SA | EUR | 41 545 | 0,14 | | | | | |
| | <i>Danemark</i> | | <i>105 517</i> | <i>0,35</i> | | | | | |
| 1 020 | NOVO NORDISK A/S-B | DKK | 105 517 | 0,35 | | | | | |
| | <i>Norvège</i> | | <i>55 512</i> | <i>0,18</i> | | | | | |
| 1 750 | EQUINOR ASA | NOK | 55 512 | 0,18 | | | | | |
| | <i>Portugal</i> | | <i>5 290</i> | <i>0,02</i> | | | | | |
| 359 | GALP ENERGIA SGPS SA | EUR | 5 290 | 0,02 | | | | | |
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | | | | 60 000 | 0,20 |
| | <i>Luxembourg</i> | | | | | | | <i>60 000</i> | <i>0,20</i> |
| 426,54 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D 1 VNAV - X CAP | USD | | | | | | 60 000 | 0,20 |
| | Total portefeuille-titres | | | | | | | 29 620 070 | 98,55 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Japan Multi-Factor Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en JPY

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|----------------------------------|--------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 2 672 303 457 | 98,90 | | | | | |
| | <i>Japon</i> | | <i>2 672 303 457</i> | <i>98,90</i> | | | | | |
| 8 300 | AEON CO LTD | JPY | 26 169 973 | 0,97 | 3 700 | SONY CORP | JPY | 49 608 014 | 1,84 |
| 20 300 | ASTELLAS PHARMA INC | JPY | 34 393 489 | 1,27 | 18 100 | SUBARU CORP | JPY | 46 930 558 | 1,74 |
| 9 700 | BRIDGESTONE CORP | JPY | 56 733 403 | 2,10 | 3 000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GR | JPY | 20 605 461 | 0,76 |
| 11 100 | BROTHER INDUSTRIES LTD | JPY | 25 010 487 | 0,93 | 4 000 | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS | JPY | 10 831 970 | 0,40 |
| 15 500 | CANON INC | JPY | 56 180 351 | 2,08 | 5 100 | SUNTORY BEVERAGE AND FOOD LTD | JPY | 23 732 099 | 0,88 |
| 9 500 | CENTRAL JAPAN RAILWAY CO | JPY | 34 079 065 | 1,26 | 10 800 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 43 666 338 | 1,62 |
| 12 300 | DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC | JPY | 36 851 131 | 1,36 | 19 000 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | JPY | 67 123 958 | 2,48 |
| 4 900 | DAIICHI SANKYO CO LTD | JPY | 18 988 225 | 0,70 | 2 400 | TOKYO ELECTRON LTD | JPY | 60 642 403 | 2,24 |
| 12 500 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | JPY | 53 474 007 | 1,98 | 69 400 | TOYOTA MOTOR CORP | JPY | 180 294 909 | 6,68 |
| 105 | DAIWA HOUSE REIT INVESTMENT | JPY | 26 429 544 | 0,98 | 4 300 | TREND MICRO INC | JPY | 32 487 795 | 1,20 |
| 49 500 | DAIWA SECURITIES GROUP INC | JPY | 47 039 768 | 1,74 | 11 300 | USS CO LTD | JPY | 32 073 011 | 1,19 |
| 700 | DISCO CORP | JPY | 24 512 800 | 0,91 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 1 700 | FAST RETAILING CO LTD | JPY | 59 607 004 | 2,21 | | | | 2 672 303 457 | 98,90 |
| 4 500 | FUJI ELECTRIC HOLDINGS CO LTD | JPY | 27 369 999 | 1,01 | | | | | |
| 8 700 | HITACHI LTD | JPY | 88 626 247 | 3,28 | | | | | |
| 3 000 | HOYA CORP | JPY | 52 958 040 | 1,96 | | | | | |
| 29 200 | HULIC CO LTD | JPY | 43 152 835 | 1,60 | | | | | |
| 15 800 | INPEX CORP | JPY | 30 105 180 | 1,11 | | | | | |
| 8 500 | JAPAN AIRLINES CO LTD | JPY | 23 600 141 | 0,87 | | | | | |
| 8 800 | JAPAN EXCHANGE GROUP INC | JPY | 26 281 181 | 0,97 | | | | | |
| 74 | JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT | JPY | 43 223 783 | 1,60 | | | | | |
| 7 600 | KAJIMA CORP | JPY | 17 943 548 | 0,66 | | | | | |
| 6 600 | KAO CORP | JPY | 38 317 733 | 1,42 | | | | | |
| 13 600 | KDDI CORP | JPY | 61 046 981 | 2,26 | | | | | |
| 15 000 | KIRIN HOLDINGS CO LTD | JPY | 31 007 872 | 1,15 | | | | | |
| 15 400 | KOMATSU LTD | JPY | 56 905 797 | 2,11 | | | | | |
| 9 600 | KYOCERA CORP | JPY | 19 786 334 | 0,73 | | | | | |
| 15 300 | MAZDA MOTOR CORP | JPY | 23 341 139 | 0,86 | | | | | |
| 13 600 | MITSUBISHI ESTATE CO LTD | JPY | 26 442 684 | 0,98 | | | | | |
| 78 000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP | JPY | 94 501 252 | 3,51 | | | | | |
| 6 660 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC | JPY | 16 047 005 | 0,59 | | | | | |
| 9 600 | MS&AD INSURANCE GROUP HOLDING | JPY | 53 317 576 | 1,97 | | | | | |
| 1 400 | NEC CORP | JPY | 11 700 456 | 0,43 | | | | | |
| 3 100 | NINTENDO CO LTD | JPY | 22 806 916 | 0,84 | | | | | |
| 62 | NIPPON BUILDING FUND INC | JPY | 37 895 175 | 1,40 | | | | | |
| 237 400 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE | JPY | 40 927 163 | 1,51 | | | | | |
| 5 200 | NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS | JPY | 19 308 137 | 0,71 | | | | | |
| 270 | NOMURA REAL ESTATE MASTER FUND | JPY | 44 557 395 | 1,65 | | | | | |
| 3 400 | NOMURA RESEARCH INSTITUTE LTD | JPY | 13 951 246 | 0,52 | | | | | |
| 31 500 | OBAYASHI CORP | JPY | 38 474 690 | 1,42 | | | | | |
| 7 400 | OLYMPUS CORP | JPY | 15 125 160 | 0,56 | | | | | |
| 10 800 | ONO PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 27 165 577 | 1,01 | | | | | |
| 1 300 | ORACLE CORP JAPAN | JPY | 14 151 209 | 0,52 | | | | | |
| 9 600 | ORIENTAL LAND CO LTD | JPY | 50 455 185 | 1,87 | | | | | |
| 6 300 | RECRUIT HOLDINGS CO LTD | JPY | 37 491 954 | 1,39 | | | | | |
| 11 700 | RENASAS ELECTRONICS CORP | JPY | 29 869 147 | 1,11 | | | | | |
| 12 800 | RICOH CO LTD | JPY | 13 879 750 | 0,51 | | | | | |
| 5 100 | SECOM CO LTD | JPY | 51 835 672 | 1,92 | | | | | |
| 18 900 | SEIKO EPSON CORP | JPY | 39 960 321 | 1,48 | | | | | |
| 21 900 | SEKISUI CHEMICAL CO LTD | JPY | 44 564 234 | 1,65 | | | | | |
| 15 400 | SEKISUI HOUSE LTD | JPY | 48 284 771 | 1,79 | | | | | |
| 11 300 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD | JPY | 63 216 394 | 2,34 | | | | | |
| 13 400 | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD | JPY | 79 427 600 | 2,94 | | | | | |
| 4 900 | SHIONOGI & CO LTD | JPY | 33 347 384 | 1,23 | | | | | |
| 7 600 | SOMPO HOLDINGS INC | JPY | 52 466 831 | 1,94 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Multi-Asset Balanced

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Instruments du marché monétaire | | | 2 195 380 | 0,22 |
| <i>France</i> | | | | |
| 2 200 000 | FRENCH BTF 0,000% 23-24/01/2024 | EUR | 2 195 380 | 0,22 |
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 579 506 698 | 58,04 |
| <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 478 000,00 | BNP PARIBAS EASY ECPI CIRCULAR ECONOMY LEADERS - UCITS ETF CAP | EUR | 8 287 660 | 0,83 |
| 546 050,00 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL ESG BLUE ECONOMY - UCITS ETF CAP | EUR | 7 999 578 | 0,80 |
| 87,00 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL ESG HYDROGEN ECONOMY - TRACK X CAP | EUR | 8 251 321 | 0,83 |
| 35,50 | BNP PARIBAS EASY JPM ESG GREEN SOCIAL & SUSTAINABILITY IG EUR BOND - TRACK X CAP | EUR | 2 868 451 | 0,29 |
| 2 590 260,00 | BNP PARIBAS EASY JPM ESG GREEN SOCIAL & SUSTAINABILITY IG EUR BOND - UCITS ETF CAP | EUR | 20 878 531 | 2,09 |
| 250 200,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EMERGING SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF CAP | USD | 31 018 502 | 3,10 |
| 1 118 000,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EUROPE SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF CAP | EUR | 33 760 580 | 3,37 |
| 120,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI JAPAN SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - TRACK X CAP | EUR | 14 805 609 | 1,48 |
| 556 215,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI PACIFIC EX JAPAN ESG FILTERED MIN TE - UCITS ETF CAP | EUR | 7 151 479 | 0,72 |
| 486,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI USA SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - TRACK X CAP | USD | 120 412 492 | 12,06 |
| 2 860 000,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI USA SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF CAP | USD | 49 983 007 | 5,00 |
| 871 500,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI WORLD SRI S-SERIES PAB 5% CAPPED - UCITS ETF CAP | EUR | 15 949 321 | 1,60 |
| 132,00 | BNP PARIBAS FUNDS EMERGING MARKETS CLIMATE SOLUTION - X CAP | USD | 10 375 115 | 1,04 |
| 6 335,00 | BNP PARIBAS FUNDS ENERGY TRANSITION - X CAP | EUR | 8 393 305 | 0,84 |
| 116 690,00 | BNP PARIBAS FUNDS GLOBAL ENVIRONMENT - X CAP | EUR | 26 023 036 | 2,61 |
| 270,00 | BNP PARIBAS FUNDS GREEN BOND - X CAP | EUR | 24 883 237 | 2,49 |
| 876,00 | BNP PARIBAS FUNDS GREEN TIGERS - X CAP | EUR | 9 958 263 | 1,00 |
| 110 320,00 | BNP PARIBAS FUNDS INCLUSIVE GROWTH - X CAP | EUR | 18 187 354 | 1,82 |
| 0,51 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV - I CAP | USD | 79 | 0,00 |
| 133 510,00 | DPAM L BONDS EMK SUSTAN - F | EUR | 20 249 461 | 2,03 |
| 1 483 300,00 | JAN HN HOR GL SUST EQ -IU2EU | EUR | 26 135 745 | 2,62 |
| 2 952 500,00 | LOF GOLDEN AGE - IX1 EUR CAP | EUR | 26 248 315 | 2,63 |
| 310 746,00 | PICTET HUMAN-JEURACC | EUR | 26 295 325 | 2,64 |
| 93 740,00 | SPARINVEST ETHICAL GLOBAL VALUE - I EUR ACC | EUR | 26 010 037 | 2,61 |
| 752 000,00 | TEMP GLB CLI CHANGE-I ACC | EUR | 27 132 159 | 2,71 |
| <i>Irlande</i> | | | | |
| 117 110,00 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL | EUR | 8 192 149 | 0,82 |
| <i>France</i> | | | | |
| 50,00 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 56 587 | 0,01 |
| Total portefeuille-titres | | | 978 963 712 | 98,10 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Multi-Asset Flexible

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 92 409 573 | 98,28 |
| <i>Luxembourg</i> | | | <i>72 094 059</i> | <i>76,68</i> |
| 81,00 | AMSELECT DPAM EMERGING BOND LOCAL CCY - X CAP | USD | 7 845 233 | 8,34 |
| 28,33 | AMSELECT VONTOBEL GLOBAL EQUITY EMERGING - X CAP | USD | 1 927 160 | 2,05 |
| 112,54 | BNP PARIBAS EASY € CORP BOND SRI FOSSIL FREE 1-3Y - X CAP | EUR | 11 186 543 | 11,90 |
| 61,25 | BNP PARIBAS EASY EUR CORP BOND SRI FOSSIL FREE - TRACK X CAP | EUR | 6 052 408 | 6,44 |
| 34 833,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EUROPE SRI S-SERIES PAB SPC CAPPED - UCITS ETF DIS | EUR | 948 861 | 1,01 |
| 114 800,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI JAPAN SRI S-SERIES PAB SPC CAPPED - UCITS ETF DIS | EUR | 2 504 086 | 2,66 |
| 4,26 | BNP PARIBAS EASY MSCI NORTH AMERICA ESG FILTERED MIN TE - X CAP | EUR | 1 932 797 | 2,06 |
| 129,01 | BNP PARIBAS FUNDS GREEN TIGERS - X CAP | EUR | 1 466 616 | 1,56 |
| 165 322,46 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ENHANCED BOND 12M - X CAP | EUR | 17 674 624 | 18,80 |
| 120 684,29 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE EURO MULTI-FACTOR CORPORATE BOND - X CAP | EUR | 12 033 431 | 12,80 |
| 65 342,52 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE US MULTI-FACTOR CORPORATE BOND - X CAP | USD | 6 063 696 | 6,45 |
| 36 319,17 | FIDELITY-ASEAN F-I ACC USD | USD | 427 749 | 0,45 |
| 17 997,65 | THEAM QUANT CROSS ASSET HIGH FOCUS - J CAP | EUR | 2 030 855 | 2,16 |
| <i>France</i> | | | <i>12 997 347</i> | <i>13,82</i> |
| 62 177,00 | AMUNDI PEA MSCI EM ALAT ESG | EUR | 1 486 341 | 1,58 |
| 343,48 | BNP PARIBAS INVEST 3 MOIS - X | EUR | 3 523 613 | 3,75 |
| 4 164,70 | BNP PARIBAS MOIS - ISR - X CAP | EUR | 4 711 262 | 5,01 |
| 0 | BNP PARIBAS MONEY 3M - IC | EUR | 47 | 0,00 |
| 51,54 | OFI PRECIOUS METALS-XL | EUR | 3 276 084 | 3,48 |
| <i>Irlande</i> | | | <i>7 318 167</i> | <i>7,78</i> |
| 263 542,00 | AMUNDI 500 EW ESG ETF A | EUR | 2 773 516 | 2,95 |
| 157 500,00 | BNP PARIBAS EASY S&P 500 ESG | EUR | 1 874 077 | 1,99 |
| 52 183,00 | IVZ FTSE ALL SHR ESG CLIMATE | GBP | 2 670 574 | 2,84 |
| Total portefeuille-titres | | | 92 409 573 | 98,28 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable Multi-Asset Growth

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Actions/Parts de fonds d'investissements | | | 534 990 393 | 99,84 |
| <i>Luxembourg</i> | | | <i>499 053 161</i> | <i>93,13</i> |
| 380 300,00 | BNP PARIBAS EASY ECPI CIRCULAR ECONOMY LEADERS - UCITS ETF CAP | EUR | 6 593 717 | 1,23 |
| 472 240,00 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL ESG BLUE ECONOMY - UCITS ETF CAP | EUR | 6 918 269 | 1,29 |
| 68,50 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL ESG HYDROGEN ECONOMY - TRACK X CAP | EUR | 6 496 730 | 1,21 |
| 163,00 | BNP PARIBAS EASY JPM ESG GREEN SOCIAL & SUSTAINABILITY IG EUR BOND - TRACK X CAP | EUR | 13 170 633 | 2,46 |
| 1 559 425,00 | BNP PARIBAS EASY JPM ESG GREEN SOCIAL & SUSTAINABILITY IG EUR BOND - UCITS ETF CAP | EUR | 12 569 589 | 2,35 |
| 210 060,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EMERGING SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF CAP | USD | 26 042 154 | 4,86 |
| 60,20 | BNP PARIBAS EASY MSCI EUROPE SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - TRACK X CAP | EUR | 9 567 758 | 1,79 |
| 587 840,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EUROPE SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF CAP | EUR | 17 751 181 | 3,31 |
| 23,97 | BNP PARIBAS EASY MSCI JAPAN SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - TRACK X CAP | EUR | 2 957 050 | 0,55 |
| 325 100,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI JAPAN SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF CAP | EUR | 8 193 788 | 1,53 |
| 428 500,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI PACIFIC EX JAPAN ESG FILTERED MIN TE - UCITS ETF CAP | EUR | 5 509 396 | 1,03 |
| 298,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI USA SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - TRACK X CAP | USD | 73 833 176 | 13,78 |
| 1 828 975,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI USA SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF CAP | USD | 31 964 221 | 5,96 |
| 567 350,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI WORLD SRI S-SERIES PAB 5% CAPPED - UCITS ETF CAP | EUR | 10 383 072 | 1,94 |
| 105,20 | BNP PARIBAS FUNDS EMERGING MARKETS CLIMATE SOLUTION - X CAP | USD | 8 268 653 | 1,54 |
| 5 045,00 | BNP PARIBAS FUNDS ENERGY TRANSITION - X CAP | EUR | 6 684 171 | 1,25 |
| 97 983,83 | BNP PARIBAS FUNDS GLOBAL ENVIRONMENT - X CAP | EUR | 21 851 374 | 4,08 |
| 697,00 | BNP PARIBAS FUNDS GREEN TIGERS - X CAP | EUR | 7 923 412 | 1,48 |
| 87 890,00 | BNP PARIBAS FUNDS INCLUSIVE GROWTH - X CAP | EUR | 14 489 545 | 2,70 |
| 775 100,00 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE EURO BOND - X CAP | EUR | 90 376 661 | 16,87 |
| 71 130,00 | DPAM L BONDS EMK SUSTAN - F | EUR | 10 788 287 | 2,01 |
| 1 198 530,00 | JAN HN HOR GL SUST EQ -IU2EU | EUR | 21 118 099 | 3,94 |
| 2 412 600,00 | LOF GOLDEN AGE - IX1 EUR CAP | EUR | 21 448 497 | 4,00 |
| 250 200,00 | PICTET HUMAN-JEURACC | EUR | 21 171 924 | 3,95 |
| 75 320,00 | SPARINVEST ETHICAL GLOBAL VALUE - I EUR ACC | EUR | 20 899 040 | 3,90 |
| 612 050,00 | TEMP GLB CLI CHANGE-I ACC | EUR | 22 082 764 | 4,12 |
| <i>Irlande</i> | | | <i>35 937 232</i> | <i>6,71</i> |
| 93 200,00 | BNP PARIBAS EASY ECPI GLOBAL | EUR | 6 519 582 | 1,22 |
| 2 472 300,00 | BNP PARIBAS EASY S&P 500 ESG | EUR | 29 417 650 | 5,49 |
| Total portefeuille-titres | | | 534 990 393 | 99,84 |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--------------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|---|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| 2 720 000 | TOLL BR FIN CORP 4,350% 18-15/02/2028 | USD | 2 654 394 | 0,80 | Obligations à taux flottant | | | | |
| 470 000 | TRACTOR SUPPLY 5,250% 23-15/05/2033 | USD | 481 570 | 0,15 | Irlande | | | | |
| 1 750 000 | UNITED PARCEL 5,050% 23-03/03/2053 | USD | 1 819 153 | 0,55 | 1 380 000 | AIB GROUP PLC 22-14/10/2026 FRN | USD | 1 425 583 | 0,43 |
| 3 200 000 | VERISIGN INC 2,700% 21-15/06/2031 | USD | 2 743 520 | 0,83 | 2 570 000 | AIB GROUP PLC 23-13/09/2029 FRN | USD | 2 707 718 | 0,82 |
| 2 630 000 | VERISIGN INC 4,750% 17-15/07/2027 | USD | 2 608 132 | 0,79 | 3 100 000 | BANK OF IRELAND 21-30/09/2027 FRN | USD | 2 837 282 | 0,86 |
| 2 600 000 | VERISK ANALYTICS 5,750% 23-01/04/2033 | USD | 2 782 996 | 0,84 | 2 560 000 | BANK OF IRELAND 22-16/09/2026 FRN | USD | 2 591 693 | 0,78 |
| 2 830 000 | WEYERHAEUSER CO 4,000% 20-15/04/2030 | USD | 2 699 275 | 0,82 | Etats-Unis d'Amérique | | | | |
| 3 400 000 | WEYERHAEUSER CO 4,000% 22-09/03/2052 | USD | 2 787 820 | 0,84 | 2 760 000 | JP MORGAN CHASE 17-01/05/2028 FRN | USD | 2 637 984 | 0,80 |
| 180 000 | WEYERHAEUSER CO 4,750% 23-15/05/2026 | USD | 179 483 | 0,05 | 2 700 000 | JPMORGAN CHASE 17-01/02/2028 FRN | USD | 2 608 865 | 0,79 |
| 2 223 000 | WEYERHAEUSER CO 7,375% 02-15/03/2032 | USD | 2 583 654 | 0,78 | 2 940 000 | JPMORGAN CHASE 17-24/07/2038 FRN | USD | 2 607 068 | 0,79 |
| 2 890 000 | WILLIS NORTH AME 2,950% 19-15/09/2029 | USD | 2 591 493 | 0,78 | 220 000 | JPMORGAN CHASE 20-01/06/2028 FRN | USD | 201 289 | 0,06 |
| 2 700 000 | WILLIS NORTH AME 4,500% 18-15/09/2028 | USD | 2 634 492 | 0,80 | Royaume-Uni | | | | |
| 2 620 000 | WILLIS NORTH AME 4,650% 22-15/06/2027 | USD | 2 598 934 | 0,79 | 2 740 000 | HSBC HOLDINGS 17-13/03/2028 FRN | USD | 2 640 501 | 0,80 |
| 80 000 | WILLIS NORTH AME 5,350% 23-15/05/2033 | USD | 80 962 | 0,02 | 290 000 | HSBC HOLDINGS 18-12/09/2026 FRN | USD | 283 894 | 0,09 |
| 3 020 000 | XYLEM INC 1,950% 20-30/01/2028 | USD | 2 736 638 | 0,83 | 2 930 000 | HSBC HOLDINGS 19-22/05/2030 FRN | USD | 2 736 705 | 0,83 |
| Canada | | | 12 418 536 | 3,77 | 2 170 000 | HSBC HOLDINGS 20-04/06/2026 FRN | USD | 2 067 529 | 0,63 |
| 2 820 000 | BELL CANADA 3,200% 21-15/02/2052 | USD | 2 003 258 | 0,61 | Norvège | | | | |
| 3 610 000 | BELL CANADA 3,650% 22-15/08/2052 | USD | 2 795 906 | 0,85 | 2 870 000 | DNB BANK ASA 21-25/05/2027 FRN | USD | 2 617 621 | 0,79 |
| 2 080 000 | BELL CANADA 5,100% 23-11/05/2033 | USD | 2 133 498 | 0,65 | 2 720 000 | DNB BANK ASA 22-09/10/2026 FRN | USD | 2 745 742 | 0,83 |
| 2 960 000 | CANADIAN NATIONAL RR 4,400% 22-05/08/2052 | USD | 2 776 619 | 0,84 | Espagne | | | | |
| 3 100 000 | MAGNA INTL INC 2,450% 20-15/06/2030 | USD | 2 709 255 | 0,82 | 2 600 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 22-14/09/2026 FRN | USD | 2 613 729 | 0,79 |
| Royaume-Uni | | | 10 891 077 | 3,29 | 2 600 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 22-14/09/2028 FRN | USD | 2 666 174 | 0,81 |
| 2 620 000 | AON PLC 3,875% 16-15/12/2025 | USD | 2 563 765 | 0,78 | Danemark | | | | |
| 2 900 000 | LSEGA FIN PLC 1,375% 21-06/04/2026 | USD | 2 683 818 | 0,81 | 1 830 000 | DANSKE BANK A/S 22-01/04/2028 FRN | USD | 1 771 229 | 0,54 |
| 3 060 000 | LSEGA FIN PLC 2,000% 21-06/04/2028 | USD | 2 734 406 | 0,83 | Belgique | | | | |
| 3 370 000 | LSEGA FIN PLC 2,500% 21-06/04/2031 | USD | 2 909 088 | 0,87 | 1 600 000 | KBC GROUP NV 23-19/01/2029 FRN | USD | 1 627 541 | 0,49 |
| Japon | | | 6 511 543 | 1,97 | Italie | | | | |
| 2 930 000 | NTT FINANCE 1,162% 21-03/04/2026 | USD | 2 711 319 | 0,82 | 1 550 000 | INTESA SANPAOLO 23-20/06/2054 FRN | USD | 1 599 949 | 0,48 |
| 2 610 000 | NTT FINANCE 4,239% 22-25/07/2025 | USD | 2 581 407 | 0,78 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 1 230 000 | NTT FINANCE 4,372% 22-27/07/2027 | USD | 1 218 817 | 0,37 | Luxembourg | | | | |
| Espagne | | | 6 339 897 | 1,91 | 22 360,95 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV - I CAP | USD | 3 814 767 | 1,14 |
| 2 200 000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 1,125% 20-18/09/2025 | USD | 2 052 756 | 0,62 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 3 160 000 | TELEFONICA EMIS 4,895% 18-06/03/2048 | USD | 2 792 160 | 0,84 | 323 337 202 | | | | |
| 1 550 000 | TELEFONICA EMIS 5,520% 19-01/03/2049 | USD | 1 494 981 | 0,45 | 97,82 | | | | |
| Irlande | | | 2 746 264 | 0,83 | | | | | |
| 2 650 000 | TRANE TECH 5,250% 23-03/03/2033 | USD | 2 746 264 | 0,83 | | | | | |
| Luxembourg | | | 2 682 103 | 0,81 | | | | | |
| 2 770 000 | INGERSOLL-RAND 3,800% 19-21/03/2029 | USD | 2 682 103 | 0,81 | | | | | |
| Suède | | | 2 363 847 | 0,72 | | | | | |
| 2 360 000 | SWEDBANK AB 5,337% 22-20/09/2027 | USD | 2 363 847 | 0,72 | | | | | |
| Norvège | | | 2 265 305 | 0,69 | | | | | |
| 2 440 000 | DNB BANK ASA 1,127% 20-16/09/2026 | USD | 2 265 305 | 0,69 | | | | | |
| Mexique | | | 1 605 968 | 0,49 | | | | | |
| 1 740 000 | AMERICA MOVIL SA 5,375% 22-04/04/2032 | USD | 1 605 968 | 0,49 | | | | | |
| Pays-Bas | | | 1 552 643 | 0,47 | | | | | |
| 1 260 000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL 7,750% 22-14/10/2052 | USD | 1 552 643 | 0,47 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable US Multi-Factor Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| | Actions | | 1 123 316 523 | 98,33 | | | | | |
| | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | <i>1 064 616 677</i> | <i>93,19</i> | | | | | |
| 75 379 | ABBVIE INC | USD | 11 681 484 | 1,02 | 106 614 | MARATHON PETROLEUM CORP - W/I | USD | 15 817 253 | 1,38 |
| 14 783 | ADOBE INC | USD | 8 819 538 | 0,77 | 105 083 | MARSH & MCLENNAN COS | USD | 19 910 076 | 1,74 |
| 224 216 | AFLAC INC | USD | 18 497 820 | 1,62 | 107 102 | MASCO CORP | USD | 7 173 692 | 0,63 |
| 50 426 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC | USD | 5 967 917 | 0,52 | 25 203 | MASTERCARD INC - A | USD | 10 749 332 | 0,94 |
| 118 618 | ALPHABET INC - A | USD | 16 569 748 | 1,45 | 41 636 | MCKESSON CORP | USD | 19 276 635 | 1,69 |
| 73 227 | ALPHABET INC - C | USD | 10 319 881 | 0,90 | 81 298 | MERCK & CO INC | USD | 8 863 108 | 0,78 |
| 100 318 | AMAZON.COM INC | USD | 15 242 317 | 1,33 | 200 286 | MICROSOFT CORP | USD | 75 315 546 | 6,58 |
| 13 978 | AMERICAN EXPRESS CO | USD | 2 618 639 | 0,23 | 137 882 | MOLSON COORS BREWING CO - B | USD | 8 439 757 | 0,74 |
| 89 218 | AMERISOURCE BERGEN CORP | USD | 18 323 593 | 1,60 | 59 276 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 18 558 723 | 1,62 |
| 44 975 | AMGEN INC | USD | 12 953 700 | 1,13 | 131 969 | NETAPP INC | USD | 11 634 387 | 1,02 |
| 43 444 | ANTHEM INC | USD | 20 486 453 | 1,79 | 2 072 | NUCOR CORP | USD | 360 611 | 0,03 |
| 315 163 | APPLE INC | USD | 60 678 331 | 5,31 | 52 076 | NVIDIA CORP | USD | 25 789 077 | 2,26 |
| 131 395 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 21 295 188 | 1,86 | 2 554 | NVR INC | USD | 17 879 149 | 1,57 |
| 16 320 | ASSURANT INC | USD | 2 749 757 | 0,24 | 26 616 | OMNICOM GROUP | USD | 2 302 550 | 0,20 |
| 19 501 | AUTOMATIC DATA PROCESSING | USD | 4 543 148 | 0,40 | 3 201 | OREILLY AUTOMOTIVE INC | USD | 3 041 206 | 0,27 |
| 4 626 | AUTOZONE INC | USD | 11 961 032 | 1,05 | 121 555 | OTIS WORLDWIDE CORP | USD | 10 875 526 | 0,95 |
| 170 100 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 8 727 831 | 0,76 | 190 882 | PACCAR INC | USD | 18 639 627 | 1,63 |
| 15 245 | BROADCOM INC | USD | 17 017 231 | 1,49 | 64 932 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 19 147 148 | 1,68 |
| 51 766 | CADENCE DESIGN SYS INC | USD | 14 099 505 | 1,23 | 36 739 | PAYCHEX INC | USD | 4 375 982 | 0,38 |
| 123 838 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 12 482 870 | 1,09 | 141 056 | PEPSICO INC | USD | 23 956 951 | 2,10 |
| 66 872 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 11 940 664 | 1,05 | 129 217 | PULTEGROUP INC | USD | 13 337 779 | 1,17 |
| 65 374 | CIGNA CORP | USD | 19 576 244 | 1,71 | 56 689 | RALPH LAUREN CORP | USD | 8 174 554 | 0,72 |
| 32 944 | CINTAS CORP | USD | 19 854 031 | 1,74 | 21 422 | REPUBLIC SERVICES INC | USD | 3 532 702 | 0,31 |
| 454 378 | CISCO SYSTEMS INC | USD | 22 955 177 | 2,01 | 9 054 | SALESFORCE.COM INC | USD | 2 382 470 | 0,21 |
| 183 062 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 14 591 872 | 1,28 | 25 408 | SNAP - ON INC | USD | 7 338 847 | 0,64 |
| 260 638 | COMCAST CORP - A | USD | 11 428 976 | 1,00 | 14 684 | SYNOPSIS INC | USD | 7 560 938 | 0,66 |
| 43 543 | CUMMINS INC | USD | 10 431 597 | 0,91 | 114 032 | TIX COMPANIES INC | USD | 10 697 342 | 0,94 |
| 13 766 | DAVITA INC | USD | 1 442 126 | 0,13 | 42 863 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 22 566 084 | 1,98 |
| 22 755 | DELTA AIR LINES INC | USD | 915 434 | 0,08 | 9 424 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 3 834 531 | 0,34 |
| 7 649 | DR HORTON INC | USD | 1 162 495 | 0,10 | 111 088 | VISA INC - A | USD | 28 921 760 | 2,53 |
| 82 552 | EBAY INC | USD | 3 600 918 | 0,32 | 27 533 | YUM BRANDS INC | USD | 3 597 462 | 0,31 |
| 45 530 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 6 228 959 | 0,55 | <i>Bermudes</i> | | | | |
| 101 110 | FOX CORP - CLASS B | USD | 2 795 692 | 0,24 | 239 890 | ARCH CAPITAL GROUP LTD | USD | 17 816 630 | 1,56 |
| 195 799 | GENERAL MILLS INC | USD | 12 754 347 | 1,12 | 48 532 | EVEREST RE GROUP LTD | USD | 17 159 945 | 1,50 |
| 160 716 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 13 019 603 | 1,14 | <i>Irlande</i> | | | | |
| 69 070 | GLOBE LIFE INC | USD | 8 407 200 | 0,74 | 67 605 | ACCENTURE PLC - A | USD | 23 723 271 | 2,08 |
| 169 295 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GRP | USD | 13 607 932 | 1,19 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 87 858 | HERSHEY CO/THE | USD | 16 380 246 | 1,43 | | | | | |
| 860 230 | HEWLETT - PACKARD ENTERPRISE - W/I | USD | 14 606 705 | 1,28 | | | | | |
| 13 047 | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | USD | 2 375 728 | 0,21 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 36 950 | ILLINOIS TOOL WORKS | USD | 9 678 683 | 0,85 | 19 911,45 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D 1 VNAV - X CAP | USD | 2 800 860 | 0,25 |
| 129 692 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 21 211 127 | 1,86 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 86 175 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | USD | 2 812 752 | 0,25 | 1 126 117 383 | | | | |
| 3 042 | INTUIT INC | USD | 1 901 341 | 0,17 | 98,58 | | | | |
| 134 879 | JABIL INC | USD | 17 183 585 | 1,50 | | | | | |
| 157 925 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 24 753 165 | 2,17 | | | | | |
| 98 444 | JP MORGAN CHASE AND CO | USD | 16 745 324 | 1,47 | | | | | |
| 30 674 | JUNIPER NETWORKS INC | USD | 904 270 | 0,08 | | | | | |
| 120 572 | KELLOGG CO | USD | 6 741 181 | 0,59 | | | | | |
| 38 890 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 4 725 524 | 0,41 | | | | | |
| 291 893 | KROGER CO | USD | 13 342 429 | 1,17 | | | | | |
| 4 679 | LAM RESEARCH CORP | USD | 3 664 874 | 0,32 | | | | | |
| 6 989 | LENNAR CORP - A | USD | 1 041 641 | 0,09 | | | | | |
| 12 348 | LOWES COS INC | USD | 2 748 047 | 0,24 | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS Sustainable US Value Multi-Factor Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--------------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--|---|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | |
| Actions | | | 477 905 827 | 98,76 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | |
| 46 372 | ABBVIE INC | USD | 7 186 269 | 1,49 | 6 167 | LENNAR CORP - A | USD | 919 130 | 0,19 |
| 1 487 | ADOBE INC | USD | 887 144 | 0,18 | 61 265 | MARATHON PETROLEUM CORP - W/I | USD | 9 089 275 | 1,88 |
| 128 760 | AFLAC INC | USD | 10 622 700 | 2,20 | 30 154 | MARSH & MCLENNAN COS | USD | 5 713 278 | 1,18 |
| 18 469 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC | USD | 2 185 806 | 0,45 | 10 261 | MASCO CORP | USD | 687 282 | 0,14 |
| 11 920 | AMERICAN EXPRESS CO | USD | 2 233 093 | 0,46 | 6 600 | MASTERCARD INC - A | USD | 2 814 966 | 0,58 |
| 55 682 | AMERISOURCE BERGEN CORP | USD | 11 435 969 | 2,36 | 21 609 | MCKESSON CORP | USD | 10 004 535 | 2,07 |
| 32 850 | AMGEN INC | USD | 9 461 457 | 1,96 | 70 122 | MERCK & CO INC | USD | 7 644 700 | 1,58 |
| 20 785 | ANTHEM INC | USD | 9 801 375 | 2,03 | 24 968 | MICROSOFT CORP | USD | 9 388 967 | 1,94 |
| 19 005 | APPLE INC | USD | 3 659 033 | 0,76 | 8 566 | MOLINA HEALTHCARE INC | USD | 3 094 981 | 0,64 |
| 59 642 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 9 666 179 | 2,00 | 98 686 | MOLSON COORS BREWING CO - B | USD | 6 040 570 | 1,25 |
| 29 586 | ASSURANT INC | USD | 4 984 945 | 1,03 | 10 471 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 3 278 365 | 0,68 |
| 4 885 | AUTOMATIC DATA PROCESSING | USD | 1 138 058 | 0,24 | 47 874 | NETAPP INC | USD | 4 220 572 | 0,87 |
| 430 | AUTOZONE INC | USD | 1 111 812 | 0,23 | 4 325 | NUCOR CORP | USD | 752 723 | 0,16 |
| 140 188 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 7 193 046 | 1,49 | 1 395 | NVR INC | USD | 9 765 628 | 2,02 |
| 3 682 | BROADCOM INC | USD | 4 110 033 | 0,85 | 7 225 | OTIS WORLDWIDE CORP | USD | 646 421 | 0,13 |
| 43 741 | BUILDERS FIRSTSOURCE INC | USD | 7 302 123 | 1,51 | 66 541 | OWENS CORNING | USD | 9 863 372 | 2,04 |
| 3 830 | CADENCE DESIGN SYS INC | USD | 1 043 177 | 0,22 | 107 213 | PACCAR INC | USD | 10 469 349 | 2,16 |
| 98 146 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 4 242 852 | 0,88 | 11 979 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 3 532 368 | 0,73 |
| 84 547 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 8 522 338 | 1,76 | 20 489 | PAYCHEX INC | USD | 2 440 445 | 0,50 |
| 28 466 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 5 082 889 | 1,05 | 59 968 | PEPSICO INC | USD | 10 184 965 | 2,10 |
| 49 275 | CENTENE CORP | USD | 3 656 698 | 0,76 | 49 790 | PULTEGROUP INC | USD | 5 139 324 | 1,06 |
| 42 026 | CIGNA CORP | USD | 12 584 686 | 2,59 | 1 742 | REGENERON PHARMACEUTICALS | USD | 1 529 981 | 0,32 |
| 246 107 | CISCO SYSTEMS INC | USD | 12 433 326 | 2,57 | 6 668 | RELIANCE STEEL & ALUMINUM | USD | 1 864 906 | 0,39 |
| 2 171 | COCA-COLA CO | USD | 127 937 | 0,03 | 16 084 | REPUBLIC SERVICES INC | USD | 2 652 412 | 0,55 |
| 64 287 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 5 124 317 | 1,06 | 105 605 | ROYALTY PHARMA PLC - A | USD | 2 966 444 | 0,61 |
| 93 632 | COMCAST CORP - A | USD | 4 105 763 | 0,85 | 3 827 | SNAP - ON INC | USD | 1 105 391 | 0,23 |
| 32 956 | CUMMINS INC | USD | 7 895 269 | 1,63 | 746 | SYNOPSYS INC | USD | 384 123 | 0,08 |
| 19 538 | CVS HEALTH CORP | USD | 1 542 720 | 0,32 | 25 862 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 13 615 567 | 2,80 |
| 5 098 | DAVITA INC | USD | 534 066 | 0,11 | 6 443 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 2 621 592 | 0,54 |
| 76 298 | DELL TECHNOLOGIES - C | USD | 5 836 797 | 1,21 | 35 214 | VISA INC - A | USD | 9 167 965 | 1,89 |
| 18 051 | DELTA AIR LINES INC | USD | 726 192 | 0,15 | 10 794 | WALMART INC | USD | 1 701 674 | 0,35 |
| 5 661 | DICKS SPORTING GOODS INC | USD | 831 884 | 0,17 | 20 972 | WR BERKLEY CORP | USD | 1 483 140 | 0,31 |
| 104 020 | DROPBOX INC-CLASS A | USD | 3 066 510 | 0,63 | <i>Bermudes</i> | | | | |
| 49 204 | EBAY INC | USD | 2 146 278 | 0,44 | | | | | |
| 228 | FAIR ISAAC CORP | USD | 265 394 | 0,05 | 134 800 | ARCH CAPITAL GROUP LTD | USD | 10 011 596 | 2,07 |
| 3 996 | FEDEX CORP | USD | 1 010 868 | 0,21 | 27 459 | EVEREST RE GROUP LTD | USD | 9 708 953 | 2,01 |
| 14 203 | FISERV INC | USD | 1 886 727 | 0,39 | <i>Royaume-Uni</i> | | | | |
| 101 600 | GENERAL MILLS INC | USD | 6 618 224 | 1,37 | 54 532 | FERGUSON PLC | USD | 10 528 493 | 2,18 |
| 81 375 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 6 592 189 | 1,36 | <i>Suisse</i> | | | | |
| 53 931 | GLOBE LIFE INC | USD | 6 564 481 | 1,36 | 11 395 | CHUBB LTD | USD | 2 575 270 | 0,53 |
| 101 479 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GRP | USD | 8 156 882 | 1,69 | <i>Irlande</i> | | | | |
| 52 109 | HERSHEY CO/THE | USD | 9 715 202 | 2,01 | 4 378 | ACCENTURE PLC - A | USD | 1 536 284 | 0,32 |
| 372 858 | HEWLETT - PACKARD ENTERPRISE - W/I | USD | 6 331 129 | 1,31 | 7 903 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | USD | 972 069 | 0,20 |
| 36 389 | HOLOGIC INC | USD | 2 599 994 | 0,54 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 826 | ILLINOIS TOOL WORKS | USD | 216 362 | 0,04 | | | | | |
| 46 872 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 7 665 916 | 1,58 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 50 655 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC | USD | 1 653 379 | 0,34 | 7 822,36 | BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D 1 VNAV - X CAP | USD | 1 100 338 | 0,23 |
| 73 777 | JABIL INC | USD | 9 399 190 | 1,94 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 54 390 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 8 525 089 | 1,76 | 479 006 165 | | | | |
| 94 971 | JP MORGAN CHASE AND CO | USD | 16 154 567 | 3,33 | 98,99 | | | | |
| 59 118 | KELLOGG CO | USD | 3 305 287 | 0,68 | | | | | |
| 78 890 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 9 585 924 | 1,98 | | | | | |
| 163 935 | KROGER CO | USD | 7 493 469 | 1,55 | | | | | |
| 1 999 | LAM RESEARCH CORP | USD | 1 565 737 | 0,32 | | | | | |

Les notes en annexe font partie intégrante de ces états financiers.

BNP PARIBAS FUNDS Target Risk Balanced

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--------------|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| | Actions/Parts de fonds d'investissements | | 569 400 511 | 99,05 |
| | <i>Luxembourg</i> | | <i>451 655 840</i> | <i>78,57</i> |
| 4 422 820,00 | BNP PARIBAS EASY € CORP BOND SRI PAB - UCITS ETF CAP | EUR | 43 716 480 | 7,60 |
| 2 764 208,00 | BNP PARIBAS EASY ENERGY & METALS ENHANCED ROLL - UCITS ETF RH EUR CAP | EUR | 28 468 302 | 4,95 |
| 2 709 527,00 | BNP PARIBAS EASY EUR HIGH YIELD SRI FOSSIL FREE - UCITS ETF CAP | EUR | 26 916 712 | 4,68 |
| 1 375 437,00 | BNP PARIBAS EASY FTSE EPRA NAREIT DEVELOPED EUROPE EX UK GREEN CTB - UCITS ETF CAP | EUR | 10 181 672 | 1,77 |
| 12 829,00 | BNP PARIBAS EASY FTSE EPRA/NAREIT DEVELOPED EUROPE - UCITS ETF QD DIS | EUR | 98 575 | 0,02 |
| 177,84 | BNP PARIBAS EASY JPM ESG EMBI GLOBAL DIVERSIFIED COMPOSITE - TRACK IH EUR CAP | EUR | 19 523 982 | 3,40 |
| 414 996,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EMERGING ESG FILTERED MIN TE - UCITS ETF EUR CAP | EUR | 4 144 192 | 0,72 |
| 749 466,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EMERGING SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF EUR CAP | EUR | 9 331 226 | 1,62 |
| 1 712 656,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EUROPE ESG FILTERED MIN TE - UCITS ETF CAP | EUR | 24 343 350 | 4,23 |
| 1 299 119,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI EUROPE SRI S-SERIES PAB 5PC CAPPED - UCITS ETF DIS | EUR | 35 336 167 | 6,15 |
| 1 078 098,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI JAPAN ESG FILTERED MIN TE - UCITS ETF CAP | EUR | 14 330 294 | 2,49 |
| 1 655 617,00 | BNP PARIBAS EASY MSCI NORTH AMERICA ESG FILTERED MIN TE - UCITS ETF CAP | EUR | 32 787 177 | 5,70 |
| 558 522,00 | BNP PARIBAS FUNDS ENHANCED BOND 6 MONTHS - X CAP | EUR | 65 961 449 | 11,48 |
| 608 571,39 | BNP PARIBAS FUNDS SUSTAINABLE ENHANCED BOND 12M - X CAP | EUR | 65 056 282 | 11,32 |
| 6 121,00 | ELEV-ABS LRET EUR FD-IEURA | EUR | 7 970 215 | 1,39 |
| 658,00 | EXANE FUNDS 2 EXANE PLEIADE FD SHARE SCA | EUR | 7 783 660 | 1,35 |
| 116 464,00 | THEAM QUANT CROSS ASSET HIGH FOCUS - J CAP | EUR | 13 141 798 | 2,29 |
| 1 104 192,00 | UBS ETF BM US LIQ. C. SUST.U | EUR | 15 388 020 | 2,68 |
| 2 669 052,00 | UBS FDSOL BBG BARCLAYS TIPS 10+ U ETF - A EUR HGD CAP | EUR | 27 176 287 | 4,73 |
| | <i>Irlande</i> | | <i>110 402 592</i> | <i>19,20</i> |
| 1 870 484,00 | BNP PARIBAS EASY S&P 500 ESG | EUR | 22 196 285 | 3,86 |
| 1 832 515,00 | ISHARES EUR HY CORP ESG EURA | EUR | 9 502 873 | 1,65 |
| 6 094 570,00 | ISHARES USD HY CORP ESG USDA | EUR | 30 683 722 | 5,34 |
| 151 625,00 | SOURCE PHYSICAL GOLD P - ETC | USD | 27 358 797 | 4,76 |
| 391 083,00 | SPDR BLOOMBERG BARCLAYS EMERGING MARKETS LOCAL BOND | EUR | 20 660 915 | 3,59 |
| | <i>France</i> | | <i>7 342 079</i> | <i>1,28</i> |
| 311,87 | BNP PARIBAS MOIS ISR - I CAP | EUR | 7 342 008 | 1,28 |
| 0 | BNP PARIBAS MONEY 3M - IC | EUR | 71 | 0,00 |
| | Total portefeuille-titres | | 569 400 511 | 99,05 |

BNP PARIBAS FUNDS Turkey Equity

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en EUR

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|--|--------------------|---------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 28 074 133 | 100,00 |
| Actions | | | 28 074 133 | 100,00 |
| <i>Turquie</i> | | | <i>28 074 133</i> | <i>100,00</i> |
| 1 450 000 | AKBANK T.A.S. | TRY | 1 623 124 | 5,79 |
| 3 600 000 | AKSIGORTA | TRY | 579 315 | 2,06 |
| 1 | ANADOLU EFES BIRACILIK VE | TRY | 3 | 0,00 |
| 900 000 | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI | TRY | 1 240 838 | 4,42 |
| 285 000 | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | TRY | 2 627 262 | 9,37 |
| 1 | BIOTREND CEVRE VE ENERJI YAT | TRY | 1 | 0,00 |
| 60 000 | COCA-COLA ICECEK AS | TRY | 966 444 | 3,44 |
| 680 000 | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIK | TRY | 854 566 | 3,04 |
| 825 000 | GALATA WIND ENERJI AS | TRY | 549 751 | 1,96 |
| 790 000 | HACI OMER SABANCI HOLDING | TRY | 1 463 781 | 5,21 |
| 1 | HEKTAS TICARET T.A.S | TRY | 1 | 0,00 |
| 950 000 | IS YATIRIM MENKUL DEGERLER A | TRY | 931 808 | 3,32 |
| 1 220 000 | KARDEMIR KARABUK DEMIR - D | TRY | 888 503 | 3,16 |
| 1 | KAREL ELEKTRONIK SANAYI VE | TRY | 0 | 0,00 |
| 360 000 | KOC HOLDING AS | TRY | 1 564 701 | 5,58 |
| 1 | KOZA ALTIN ISLETMELERI AS | TRY | 0 | 0,00 |
| 365 000 | MAVI GIYIM SANAYI VE TICA - B | TRY | 1 303 382 | 4,64 |
| 125 000 | MIGROS TICARET A.S | TRY | 1 283 535 | 4,57 |
| 215 000 | MLP SAGLIK HIZMETLERI AS | TRY | 981 923 | 3,50 |
| 100 000 | OTOKAR OTOBUS KAROSERI SAN | TRY | 1 304 225 | 4,65 |
| 28 500 | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS | TRY | 567 384 | 2,02 |
| 175 000 | TAV HAVALIMANLARI HOLDING AS | TRY | 576 633 | 2,05 |
| 127 500 | TUPRAS-TURKIYE PETROL RAFINE | TRY | 558 855 | 1,99 |
| 170 000 | TURK HAVA YOLLARI AO | TRY | 1 191 178 | 4,24 |
| 1 | TURK SISE VE CAM FABRIKALARI | TRY | 1 | 0,00 |
| 1 780 000 | TURK TELEKOMUNIKASYON AS | TRY | 1 329 077 | 4,73 |
| 1 560 000 | TURKCELL ILETISIM HIZMET AS | TRY | 2 682 502 | 9,56 |
| 310 000 | TURKIYE GARANTI BANKASI | TRY | 554 441 | 1,97 |
| 1 750 000 | TURKIYE IS BANKASI - C | TRY | 1 253 036 | 4,46 |
| 2 000 000 | YAPI VE KREDI BANKASI | TRY | 1 197 863 | 4,27 |
| Autres valeurs mobilières | | | 0 | 0,00 |
| Warrants, droits | | | 0 | 0,00 |
| 1 | KAREL ELEKTRONIK SANAYI VE T RTS 10/01/2024 | TRY | 0 | 0,00 |
| Total portefeuille-titres | | | 28 074 133 | 100,00 |

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|--|-------------------------------|--------------------|----------------------|-------------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | 1 397 953 472 | 99,28 |
| Actions | | | 1 397 953 472 | 99,28 |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | <i>1 281 579 179</i> | <i>91,02</i> |
| 271 599 | ADVANCED MICRO DEVICES | USD | 40 036 409 | 2,84 |
| 91 840 | ALBEMARLE CORP | USD | 13 269 043 | 0,94 |
| 761 877 | ALPHABET INC - A | USD | 106 426 598 | 7,56 |
| 713 028 | AMAZON.COM INC | USD | 108 337 474 | 7,69 |
| 85 311 | AMERICAN TOWER CORP - A | USD | 18 416 939 | 1,31 |
| 613 511 | APPLE INC | USD | 118 119 274 | 8,38 |
| 100 995 | ARISTA NETWORKS INC | USD | 23 785 332 | 1,69 |
| 5 817 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 20 634 179 | 1,47 |
| 437 935 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 25 317 022 | 1,80 |
| 74 973 | CHARLES RIVER LABORATORIES | USD | 17 723 617 | 1,26 |
| 449 070 | CIENA CORP | USD | 20 212 641 | 1,44 |
| 343 758 | COPART INC | USD | 16 844 142 | 1,20 |
| 70 485 | CUMMINS INC | USD | 16 886 091 | 1,20 |
| 112 759 | ELF BEAUTY INC | USD | 16 275 634 | 1,16 |
| 186 054 | ENTEGRIS INC | USD | 22 292 990 | 1,58 |
| 176 278 | FIRST SOLAR INC | USD | 30 369 174 | 2,16 |
| 46 316 | GARTNER INC | USD | 20 893 611 | 1,48 |
| 104 077 | HOME DEPOT INC | USD | 36 067 884 | 2,56 |
| 99 449 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 12 772 235 | 0,91 |
| 61 122 | INTUIT INC | USD | 38 203 084 | 2,71 |
| 151 240 | META PLATFORMS INC - A | USD | 53 532 910 | 3,80 |
| 316 778 | MICROSOFT CORP | USD | 119 121 200 | 8,45 |
| 189 408 | NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | USD | 24 956 398 | 1,77 |
| 119 671 | NVIDIA CORP | USD | 59 263 473 | 4,21 |
| 105 627 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 31 147 290 | 2,21 |
| 742 550 | PURE STORAGE INC - A | USD | 26 479 333 | 1,88 |
| 33 301 | REGENERON PHARMACEUTICALS | USD | 29 247 935 | 2,08 |
| 89 511 | REPLIGEN CORP | USD | 16 094 078 | 1,14 |
| 59 595 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 18 503 056 | 1,31 |
| 100 941 | SNOWFLAKE INC-CLASS A | USD | 20 087 259 | 1,43 |
| 206 119 | STARBUCKS CORP | USD | 19 789 485 | 1,41 |
| 58 311 | TESLA INC | USD | 14 489 117 | 1,03 |
| 71 350 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 17 402 265 | 1,24 |
| 91 070 | UNION PACIFIC CORP | USD | 22 368 613 | 1,59 |
| 45 989 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 18 712 464 | 1,33 |
| 199 945 | VISA INC - A | USD | 52 055 681 | 3,70 |
| 298 286 | YETI HOLDINGS INC | USD | 15 445 249 | 1,10 |
| <i>Canada</i> | | | <i>46 345 009</i> | <i>3,29</i> |
| 51 684 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 26 425 512 | 1,88 |
| 255 706 | SHOPIFY INC - A | USD | 19 919 497 | 1,41 |
| <i>Royaume-Uni</i> | | | <i>29 843 907</i> | <i>2,11</i> |
| 123 469 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 16 683 796 | 1,18 |
| 222 713 | NVENT ELECTRIC PLC | USD | 13 160 111 | 0,93 |
| <i>Taiwan</i> | | | <i>23 309 000</i> | <i>1,66</i> |
| 224 125 | TAIWAN SEMICONDUCTOR-SP ADR | USD | 23 309 000 | 1,66 |
| <i>Irlande</i> | | | <i>11 309 358</i> | <i>0,80</i> |
| 91 946 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | USD | 11 309 358 | 0,80 |
| <i>Danemark</i> | | | <i>5 567 019</i> | <i>0,40</i> |
| 17 433 | GENMAB A/S | DKK | 5 567 019 | 0,40 |
| Total portefeuille-titres | | | 1 397 953 472 | 99,28 |

BNP PARIBAS FUNDS US Mid Cap

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | |
|--|-------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------|---------------------|-------------------|--------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | | |
| Actions | | | 73 577 958 | 99,19 | | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | | | | | | |
| 30 556 | AES CORPORATION | USD | 588 203 | 0,79 | 10 366 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 1 116 315 | 1,50 | |
| 6 313 | ALBEMARLE CORP | USD | 912 102 | 1,23 | 5 999 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 1 463 156 | 1,97 | |
| 6 696 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 1 505 797 | 2,03 | 2 216 | ULTA BEAUTY INC | USD | 1 085 818 | 1,46 | |
| 7 415 | AXONICS INC | USD | 461 435 | 0,62 | 26 932 | US FOODS HOLDING CORP | USD | 1 222 982 | 1,65 | |
| 42 689 | BAKER HUGHES CO | USD | 1 459 110 | 1,97 | 5 169 | WATTS WATER TECHNOLOGIES - A | USD | 1 076 909 | 1,45 | |
| 18 707 | BALL CORP | USD | 1 076 027 | 1,45 | 12 569 | WAYFAIR INC - A | USD | 775 507 | 1,05 | |
| 13 692 | BLOCK INC - A | USD | 1 059 076 | 1,43 | 20 145 | XCEL ENERGY INC | USD | 1 247 177 | 1,68 | |
| 9 235 | BOK FINANCIAL CORPORATION | USD | 790 978 | 1,07 | 12 524 | YETI HOLDINGS INC | USD | 648 493 | 0,87 | |
| 15 035 | CBRE GROUP INC - A | USD | 1 399 608 | 1,89 | <i>Israël</i> | | | | | |
| 11 467 | CENTENE CORP | USD | 850 966 | 1,15 | 6 098 | CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | USD | 1 335 767 | 1,80 | |
| 4 872 | CHARLES RIVER LABORATORIES | USD | 1 151 741 | 1,55 | 33 067 | JFROG LTD | USD | 1 144 449 | 1,54 | |
| 3 752 | CHART INDUSTRIES INC | USD | 511 510 | 0,69 | <i>Bermudes</i> | | | | | |
| 26 347 | CIENA CORP | USD | 1 185 878 | 1,60 | 20 464 | AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | USD | 1 133 092 | 1,53 | |
| 9 710 | COLUMBIA SPORTSWEAR CO | USD | 772 333 | 1,04 | 144 883 | KOSMOS ENERGY LTD | USD | 972 165 | 1,31 | |
| 2 272 | COOPER COS INC/THE | USD | 859 816 | 1,16 | <i>Royaume-Uni</i> | | | | | |
| 29 923 | COPART INC | USD | 1 466 228 | 1,98 | 9 267 | APTIV PLC | USD | 831 435 | 1,12 | |
| 12 654 | COSTAR GROUP INC | USD | 1 105 833 | 1,49 | 16 793 | NVENT ELECTRIC PLC | USD | 992 298 | 1,34 | |
| 6 293 | CUMMINS INC | USD | 1 507 615 | 2,03 | <i>Canada</i> | | | | | |
| 6 936 | CYTOKINETICS INC | USD | 579 087 | 0,78 | 2 380 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 1 216 870 | 1,64 | |
| 7 512 | DARDEN RESTAURANTS INC | USD | 1 234 222 | 1,66 | <i>Irlande</i> | | | | | |
| 7 398 | DICKS SPORTING GOODS INC | USD | 1 087 136 | 1,47 | 9 285 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | USD | 1 142 055 | 1,54 | |
| 7 392 | DIGITAL REALTY TRUST INC | USD | 994 815 | 1,34 | Total portefeuille-titres | | | | | |
| 12 650 | EASTMAN CHEMICAL CO | USD | 1 136 223 | 1,53 | | | | | 73 577 958 | 99,19 |
| 4 015 | ELF BEAUTY INC | USD | 579 525 | 0,78 | | | | | | |
| 11 699 | ENTEGRIS INC | USD | 1 401 774 | 1,89 | | | | | | |
| 24 770 | ESSENTIAL UTILITIES INC | USD | 925 160 | 1,25 | | | | | | |
| 8 322 | FIRST SOLAR INC | USD | 1 433 714 | 1,93 | | | | | | |
| 17 239 | FOX CORP - A | USD | 511 481 | 0,69 | | | | | | |
| 3 909 | GARTNER INC | USD | 1 763 390 | 2,39 | | | | | | |
| 41 910 | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | USD | 722 109 | 0,97 | | | | | | |
| 8 919 | HERC HOLDINGS INC | USD | 1 327 950 | 1,79 | | | | | | |
| 4 266 | HERSHEY CO/THE | USD | 795 353 | 1,07 | | | | | | |
| 15 815 | HEXCEL CORP | USD | 1 166 356 | 1,57 | | | | | | |
| 7 605 | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | USD | 1 384 794 | 1,87 | | | | | | |
| 14 656 | HOLOGIC INC | USD | 1 047 171 | 1,41 | | | | | | |
| 82 504 | HUNTINGTON BANCSHARES INC | USD | 1 049 451 | 1,41 | | | | | | |
| 9 564 | IDACORP INC | USD | 940 332 | 1,27 | | | | | | |
| 13 501 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 1 733 934 | 2,35 | | | | | | |
| 1 863 | KARUNA THERAPEUTICS INC | USD | 589 658 | 0,79 | | | | | | |
| 10 020 | NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | USD | 1 320 235 | 1,78 | | | | | | |
| 2 368 | OLD DOMINION FREIGHT LINE | USD | 959 821 | 1,29 | | | | | | |
| 18 907 | PACIFIC PREMIER BANCORP INC | USD | 550 383 | 0,74 | | | | | | |
| 4 061 | PAYCOM SOFTWARE INC | USD | 839 490 | 1,13 | | | | | | |
| 9 934 | PLEXUS CORP | USD | 1 074 163 | 1,45 | | | | | | |
| 7 159 | POWER INTEGRATIONS INC | USD | 587 825 | 0,79 | | | | | | |
| 34 249 | PURE STORAGE INC - A | USD | 1 221 319 | 1,65 | | | | | | |
| 37 539 | RADIAN GROUP INC | USD | 1 071 738 | 1,44 | | | | | | |
| 5 430 | REPLIGEN CORP | USD | 976 314 | 1,32 | | | | | | |
| 8 008 | REPUBLIC SERVICES INC | USD | 1 320 599 | 1,78 | | | | | | |
| 12 898 | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | USD | 723 578 | 0,98 | | | | | | |
| 3 979 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 1 235 400 | 1,67 | | | | | | |
| 6 959 | ROYAL GOLD INC | USD | 841 761 | 1,13 | | | | | | |
| 9 483 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 1 352 655 | 1,82 | | | | | | |
| 17 675 | SPRINGWORKS THERAPEUTICS INC | USD | 645 138 | 0,87 | | | | | | |
| 1 987 | SPS COMMERCE INC | USD | 385 160 | 0,52 | | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS US Small Cap

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devise de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | |
|--|-------------------------------|--------------------|---------------------|--------------------|----------------------------------|------------------------------|--------------------|---------------------|--------------------|--------------|
| Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou négociées sur un autre marché réglementé | | | | | | | | | | |
| Actions | | | | 746 367 371 | 97,59 | | | | | |
| <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | | <i>665 203 308</i> | <i>86,99</i> | | | | |
| 391 871 | AGIOS PHARMACEUTICALS INC | USD | 8 726 967 | 1,14 | 285 201 | PULMONX CORP | USD | 3 636 313 | 0,48 | |
| 232 525 | ALCOA CORP | USD | 7 905 850 | 1,03 | 383 181 | PURE STORAGE INC - A | USD | 13 664 234 | 1,79 | |
| 341 757 | ALPHATEC HOLDINGS INC | USD | 5 163 948 | 0,68 | 415 601 | RADIAN GROUP INC | USD | 11 865 409 | 1,55 | |
| 58 726 | AMERICAN STATES WATER CO | USD | 4 722 745 | 0,62 | 119 437 | RAPID7 INC | USD | 6 819 853 | 0,89 | |
| 203 343 | ARCUS BIOSCIENCES INC | USD | 3 883 851 | 0,51 | 187 588 | REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN | USD | 10 523 687 | 1,38 | |
| 100 077 | ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES | USD | 9 839 571 | 1,29 | 1 062 539 | RLJ LODGING TRUST | USD | 12 452 957 | 1,63 | |
| 289 780 | ARTISAN PARTNERS ASSET MA -A | USD | 12 802 480 | 1,67 | 11 951 | SAIA INC | USD | 5 237 167 | 0,68 | |
| 118 727 | ATRICURE INC | USD | 4 237 367 | 0,55 | 129 289 | SENSIENT TECHNOLOGIES CORP | USD | 8 533 074 | 1,12 | |
| 68 157 | AXCELIS TECHNOLOGIES INC | USD | 8 839 281 | 1,16 | 70 573 | SOUTHSTATE CORP | USD | 5 959 890 | 0,78 | |
| 169 751 | AXONICS INC | USD | 10 563 605 | 1,38 | 314 188 | SPRINGWORKS THERAPEUTICS INC | USD | 11 467 862 | 1,50 | |
| 172 647 | AZEK CO INC/THE | USD | 6 603 748 | 0,86 | 292 156 | SPROUTS FARMERS MARKET INC | USD | 14 055 625 | 1,84 | |
| 244 812 | BJS RESTAURANTS INC | USD | 8 815 680 | 1,15 | 32 251 | SPS COMMERCE INC | USD | 6 251 534 | 0,82 | |
| 63 239 | BOK FINANCIAL CORPORATION | USD | 5 416 420 | 0,71 | 272 602 | UNITED BANKSHARES INC | USD | 10 236 205 | 1,34 | |
| 156 566 | CASELLA WASTE SYSTEMS INC-A | USD | 13 380 130 | 1,75 | 288 999 | UNITED COMMUNITY BANKS/GA | USD | 8 456 111 | 1,11 | |
| 113 544 | CEREVEL THERAPEUTICS HOLDING | USD | 4 814 266 | 0,63 | 264 397 | VERICEL CORP | USD | 9 415 177 | 1,23 | |
| 397 356 | CHAMPIONX CORP | USD | 11 606 769 | 1,52 | 74 394 | VISTEON CORP | USD | 9 291 811 | 1,21 | |
| 60 070 | CHART INDUSTRIES INC | USD | 8 189 343 | 1,07 | 45 143 | WATTS WATER TECHNOLOGIES - A | USD | 9 405 093 | 1,23 | |
| 259 884 | CIENA CORP | USD | 11 697 379 | 1,53 | 148 180 | WAYFAIR INC - A | USD | 9 142 706 | 1,20 | |
| 238 702 | CLEARWAY ENERGY INC-C | USD | 6 547 596 | 0,86 | 86 946 | WINTRUST FINANCIAL CORP | USD | 8 064 242 | 1,05 | |
| 298 390 | COLUMBIA BANKING SYSTEM INC | USD | 7 961 045 | 1,04 | 50 917 | WOODWARD INC | USD | 6 931 331 | 0,91 | |
| 99 571 | COLUMBIA SPORTSWEAR CO | USD | 7 919 877 | 1,04 | 189 541 | YETI HOLDINGS INC | USD | 9 814 433 | 1,28 | |
| 53 293 | CONMED CORP | USD | 5 836 116 | 0,76 | 619 460 | ZYMEWORKS INC | USD | 6 436 189 | 0,84 | |
| 221 696 | CRINETICS PHARMACEUTICALS IN | USD | 7 887 944 | 1,03 | <i>Israël</i> | | | | | |
| 802 503 | CUSHMAN & WAKEFIELD PLC | USD | 8 667 032 | 1,13 | 64 805 | CYBERARK SOFTWARE LTD/ISRAEL | USD | 14 195 535 | 1,86 | |
| 160 422 | CYTOKINETICS INC | USD | 13 393 633 | 1,75 | 387 678 | JFROG LTD | USD | 13 417 536 | 1,75 | |
| 59 094 | DICKS SPORTING GOODS INC | USD | 8 683 863 | 1,14 | 55 731 | NOVA LTD | USD | 7 656 882 | 1,00 | |
| 496 266 | DIGITALBRIDGE GROUP INC | USD | 8 704 506 | 1,14 | <i>Bermudes</i> | | | | | |
| 57 056 | ELF BEAUTY INC | USD | 8 235 463 | 1,08 | 204 977 | AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD | USD | 11 349 576 | 1,48 | |
| 40 561 | EMCOR GROUP INC | USD | 8 738 056 | 1,14 | 1 926 330 | KOSMOS ENERGY LTD | USD | 12 925 674 | 1,69 | |
| 127 607 | FIRST MERCHANTS CORP | USD | 4 731 668 | 0,62 | <i>Royaume-Uni</i> | | | | | |
| 224 076 | FRONTDOOR INC | USD | 7 891 957 | 1,03 | 182 605 | BICYCLE THERAPEUTICS PLC-ADR | USD | 3 301 498 | 0,43 | |
| 164 929 | GREENBRIER COMPANIES INC | USD | 7 286 563 | 0,95 | 32 503 | IMMUNOCORE HOLDINGS PLC-ADR | USD | 2 220 605 | 0,29 | |
| 141 416 | HAMILTON LANE INC - A | USD | 16 042 231 | 2,09 | 208 565 | NVENT ELECTRIC PLC | USD | 12 324 106 | 1,61 | |
| 475 954 | HEALTHCARE REALTY TRUST INC | USD | 8 200 687 | 1,07 | <i>Canada</i> | | | | | |
| 94 826 | HERC HOLDINGS INC | USD | 14 118 643 | 1,85 | 33 452 | KINAXIS INC | CAD | 3 772 651 | 0,49 | |
| 139 570 | HEXCEL CORP | USD | 10 293 288 | 1,35 | Total portefeuille-titres | | | | 746 367 371 | 97,59 |
| 107 753 | IDACORP INC | USD | 10 594 275 | 1,39 | | | | | | |
| 150 450 | INDEPENDENT BANK CORP/MA | USD | 9 901 115 | 1,29 | | | | | | |
| 351 481 | INSMED INC | USD | 10 892 396 | 1,42 | | | | | | |
| 52 797 | IRHYTHM TECHNOLOGIES INC | USD | 5 651 391 | 0,74 | | | | | | |
| 73 341 | ITT INC | USD | 8 751 048 | 1,14 | | | | | | |
| 113 303 | JACK IN THE BOX INC | USD | 9 248 924 | 1,21 | | | | | | |
| 476 909 | LIVENT CORP | USD | 8 574 824 | 1,12 | | | | | | |
| 33 715 | MERITAGE HOMES CORP | USD | 5 873 153 | 0,77 | | | | | | |
| 341 471 | MP MATERIALS CORP | USD | 6 778 199 | 0,89 | | | | | | |
| 49 514 | MSA SAFETY INC | USD | 8 359 449 | 1,09 | | | | | | |
| 66 223 | NEXSTAR MEDIA GROUP INC - A | USD | 10 380 455 | 1,36 | | | | | | |
| 469 389 | OCEANEERING INTERNATIONAL INC | USD | 9 988 598 | 1,31 | | | | | | |
| 232 902 | PACIFIC PREMIER BANCORP INC | USD | 6 779 777 | 0,89 | | | | | | |
| 35 528 | PIPER SANDLER COS | USD | 6 212 781 | 0,81 | | | | | | |
| 48 031 | PJT PARTNERS INC - A W/I | USD | 4 892 918 | 0,64 | | | | | | |
| 142 963 | PLEXUS CORP | USD | 15 458 589 | 2,01 | | | | | | |
| 120 979 | POWER INTEGRATIONS INC | USD | 9 933 586 | 1,30 | | | | | | |
| 155 580 | PROCEPT BIROBOTICS CORP | USD | 6 520 358 | 0,85 | | | | | | |
| 159 688 | PTC THERAPEUTICS INC | USD | 4 401 001 | 0,58 | | | | | | |

BNP PARIBAS FUNDS USD Money Market

Portefeuille-titres au 31/12/2023

Exprimé en USD

| Quantité | Dénomination | Devises de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets | Quantité | Dénomination | Devises de cotation | Valeur d'évaluation | % des actifs nets |
|---------------------------------|--|---------------------|---------------------|-------------------|--|---|---------------------|---------------------|-------------------|
| Instruments du marché monétaire | | | | | 487 046 304 | | | 86,31 | |
| | <i>Royaume-Uni</i> | | | | 133 147 772 | | | 23,60 | |
| 5 000 000 | BARCLAYS BANK PLC 0,000% 07/02/2024 | USD | 4 969 702 | 0,88 | 12 000 000 | <i>Espagne</i> BANCO SANTANDER SA 0,000% 04/03/2024 | USD | 11 879 533 | 2,10 |
| 7 000 000 | BARCLAYS BANK PLC 0,000% 22/08/2024 | USD | 6 759 266 | 1,20 | 10 000 000 | BANCO SANTANDER SA 0,000% 09/10/2024 | USD | 9 593 592 | 1,70 |
| 15 000 000 | FIRST ABU DHABI PJSC/UK 0,000% 11/01/2024 | USD | 14 970 683 | 2,65 | 10 000 000 | BANCO SANTANDER SA 0,000% 20/06/2024 | USD | 9 741 730 | 1,73 |
| 10 000 000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0,000% 14/02/2024 | USD | 9 928 707 | 1,76 | <i>Luxembourg</i> | | | | |
| 10 000 000 | LLOYDS BANK PLC +0,59 5,927% 02/10/2024 CD | USD | 10 009 819 | 1,77 | 20 000 000 | BELFIUS FINANCING CO 0,000% 31/01/2024 | USD | 19 900 151 | 3,52 |
| 10 000 000 | LLOYDS BANK PLC +0,71 6,048% 11/07/2024 NEUCP | USD | 10 017 865 | 1,78 | <i>Australie</i> | | | | |
| 10 000 000 | MITSUBISHI UFJ TRUST + BANKING CORPORATI 0,000% 22/02/2024 | USD | 9 916 448 | 1,76 | 10 000 000 | MACQUARIE BANK LIMITED 0,000% 20/08/2024 | USD | 9 658 742 | 1,71 |
| 10 000 000 | MITSUBISHI UFJ TRUST + BANKING CORPORATION 0,000% 23/01/2024 | USD | 9 962 171 | 1,77 | 6 000 000 | MIZUHO BANK LIMITED (SYDNEY BRANCH) 0,000% 27/02/2024 | USD | 5 945 261 | 1,05 |
| 15 000 000 | MUFG BANK LTD 0,000% 31/01/2024 | USD | 14 925 113 | 2,64 | <i>Irlande</i> | | | | |
| 5 000 000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK (GB) LIMITED 0,000% 11/04/2024 | USD | 4 921 564 | 0,87 | 5 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0,000% 18/01/2024 | USD | 4 984 792 | 0,88 |
| 10 000 000 | THE NORINCHUKIN BANK, LONDON BRANCH 0,000% 20/02/2024 | USD | 9 919 516 | 1,76 | 10 000 000 | INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 0,000% 23/02/2024 | USD | 9 914 811 | 1,76 |
| 5 000 000 | TORONTO DOMINION BANK (LONDON) FED C 5,846% 12/11/2024 | USD | 5 002 159 | 0,89 | <i>Danemark</i> | | | | |
| 7 000 000 | TORONTO DOMINION BANK (LONDON) FED C 5,892% 03/10/2024 | USD | 7 006 823 | 1,24 | 10 000 000 | DANSKE BANK A/S 0,000% 30/08/2024 | USD | 9 645 546 | 1,71 |
| 10 000 000 | UBS AG/LONDON 0,000% 16/01/2024 | USD | 9 972 734 | 1,77 | 5 000 000 | NYKREDIT BANK A/S 0,000% 24/01/2024 | USD | 4 980 332 | 0,88 |
| 5 000 000 | UBS AG/LONDON 0,000% 28/06/2024 | USD | 4 865 202 | 0,86 | <i>Etats-Unis d'Amérique</i> | | | | |
| | <i>France</i> | | | | 96 363 644 | | | 17,09 | |
| 15 000 000 | AGENCE CENTRALE DES ORGANISMES DE SECURI 0,000% 05/01/2024 | USD | 14 984 124 | 2,66 | 10 000 000 | TORONTO DOMINION BANK CAP+0,68 5,761% 06/06/2024 | USD | 10 016 635 | 1,77 |
| 12 000 000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0,000% 03/01/2024 | USD | 11 990 893 | 2,12 | <i>Norvège</i> | | | | |
| 10 000 000 | BPCE SA 0,000% 11/09/2024 NEUCP | USD | 9 629 844 | 1,71 | 10 000 000 | DNB BANK ASA SOFRCAP+0,53 5,856% 06/11/2024 CD | USD | 10 006 589 | 1,77 |
| 5 000 000 | BPCE SA FED CAP +0,63 5,590% 04/03/2024 NEUCP | USD | 5 003 858 | 0,89 | <i>Allemagne</i> | | | | |
| 5 000 000 | BPCE SA FED CAP +0,67 5,670% 17/04/2024 NEUCP | USD | 5 006 064 | 0,89 | 10 000 000 | ALLIANZ SE 0,000% 11/01/2024 | USD | 9 980 456 | 1,77 |
| 15 000 000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0,000% 05/03/2024 NEU | USD | 14 847 127 | 2,63 | Actions/Parts de fonds d'investissements | | | | |
| 10 000 000 | JYSKE BANK 0,000% 08/02/2024 NEUCP | USD | 9 937 878 | 1,76 | 154 720,07 | <i>Luxembourg</i> BNP PARIBAS INSTICASH USD 1D LVNAV - I CAP | USD | 26 395 168 | 4,67 |
| 5 000 000 | SOCIETE GENERALE SA FED CAP+0,51 5,840% 27/12/2024 | USD | 4 997 814 | 0,89 | Total portefeuille-titres | | | | |
| 5 000 000 | SOCIETE GENERALE SA FED CAP+0,65 5,723% 31/05/2024 | USD | 5 007 117 | 0,89 | | | | 513 441 472 | 90,98 |
| 15 000 000 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 0,000% 16/01/2024 NE | USD | 14 958 925 | 2,65 | | | | | |
| | <i>Pays-Bas</i> | | | | 58 003 566 | | | 10,27 | |
| 7 000 000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0,000% 03/06/2024 | USD | 6 836 149 | 1,21 | | | | | |
| 10 000 000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA SOFRCAP +0,63 5,612% 17/04/2024 | USD | 10 010 906 | 1,77 | | | | | |
| 7 000 000 | ING BANK NV 0,000% 04/06/2024 | USD | 6 835 149 | 1,21 | | | | | |
| 20 000 000 | ING BANK NV 0,000% 26/04/2024 | USD | 19 640 053 | 3,48 | | | | | |
| 5 000 000 | ING BANK NV 0,000% 26/11/2024 | USD | 4 766 396 | 0,84 | | | | | |
| 10 000 000 | NATWEST MARKETS NV 0,000% 23/02/2024 | USD | 9 914 913 | 1,76 | | | | | |
| | <i>Belgique</i> | | | | 39 624 932 | | | 7,03 | |
| 15 000 000 | EUROCLEAR BANK SA/NV 0,000% 30/04/2024 | USD | 14 722 520 | 2,61 | | | | | |
| 15 000 000 | SUMITOMO MITSUI BANKING CORP/BRUSSELS 0,000% 29/01/2024 | USD | 14 929 678 | 2,65 | | | | | |
| 10 000 000 | SUMITOMO MITSUI BANKING CORPORATION, SUC 0,000% 16/01/2024 | USD | 9 972 734 | 1,77 | | | | | |
| | <i>Suède</i> | | | | 33 658 220 | | | 5,97 | |
| 10 000 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANK AB 0,000% 20/06/2024 | USD | 9 741 730 | 1,73 | | | | | |
| 15 000 000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 0,000% 12/11/2024 | USD | 14 325 473 | 2,54 | | | | | |
| 10 000 000 | SWEDBANK AB 0,000% 11/10/2024 | USD | 9 591 017 | 1,70 | | | | | |

Notes aux états financiers

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Note 1 - Informations générales

Depuis le 1 janvier 2023, la Société a procédé aux changements suivants :

a) Compartiments liquidés, fusionnés et renommés

| Compartiment | Date | Evénements |
|--------------------------------------|------------------|--|
| Absolute Return Global Opportunities | 26 janvier 2023 | Fusionné avec le compartiment « Sustainable Multi-Asset Flexible » |
| Euro High Quality Government Bond | 23 mai 2023 | Liquidation du compartiment |
| Harmony | 29 juin 2023 | Fusionné avec le compartiment « Sustainable Multi-Asset Flexible » |
| Europe Emerging Equity | 3 juillet 2023 | Liquidation du compartiment |
| Emerging Multi-Asset Income | 27 octobre 2023 | Compartiment renommé « Multi-Asset Opportunities » |
| Euro Government Bond | 24 novembre 2023 | Absorption du fonds français « CamGestion Capi Oblig » |

Au 31 décembre 2023, la liquidation des compartiments suivants n'est pas terminée. Il reste encore le montant suivant en banque :

- (70) EUR pour le compartiment Absolute Return Global Opportunities
- 96 987 EUR pour le compartiment Europe Emerging Equity
- 9 453 EUR pour le compartiment Europe Multi-Asset Income
- 432 EUR pour le compartiment Multi-Asset Income

Il ne reste pas d'avoirs en banque pour le compartiment Euro High Quality Government Bond. La clôture du compte de trésorerie est en cours.

Les titres restants dans le portefeuille du compartiment Asia ex-Japan Small Cap en fin de période sont :

- CHINA ZHOGWANG HOLDINGS LTD, 1 780 800 actions détenues

Les titres restants dans le portefeuille du compartiment Multi-Asset Income en fin de période sont :

- RUSSIE 5,25% 17-230647, 200 000 obligations détenues

b) Classes d'actions activées et fractionnées

| Compartiment | Date | Evénements |
|---|-----------------|--|
| Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | 26 janvier 2023 | Activation de la classe d'actions « XH EUR - Capitalisation » |
| SMaRT Food | 6 février 2023 | Activation de la classe d'actions « I USD - Capitalisation » |
| Asia Tech Innovators | 24 février 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic EUR - Capitalisation » |
| Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond | 24 février 2023 | Activation de la classe d'actions « Privilege H CZK - Capitalisation » |
| Aqua | 4 avril 2023 | Activation de la classe d'actions « UI15 JPY - Capitalisation » |
| Asia Tech Innovators | 14 avril 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic RH CZK - Capitalisation » |
| SMaRT Food | 2 mai 2023 | Activation de la classe d'actions « I MD - Distribution » |
| Sustainable Europe Value | 2 mai 2023 | Activation de la classe d'actions « I MD - Distribution » |
| Disruptive Technology | 19 mai 2023 | Fractionnement par 1 000 de la classe d'actions « X NOK - Capitalisation » |
| Sustainable Japan Multi-Factor Equity | 2 juin 2023 | Activation de la classe d'actions « N - Capitalisation » |
| Sustainable Multi-Asset Growth | 7 juin 2023 | Activation de la classe d'actions « Privilege USD - Capitalisation » |
| Inclusive Growth | 16 juin 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic RH SGD - Capitalisation » |
| Asia Tech Innovators | 16 juin 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic RH SGD - Capitalisation » |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Date | Evénements |
|--|-------------------|---|
| Sustainable Global Equity | 22 juin 2023 | Activation de la classe d'actions « Privilege H NOK - Capitalisation » |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | 29 juin 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic H EUR - Capitalisation » |
| Emerging Markets Climate Solutions | 9 août 2023 | Activation de la classe d'actions « X EUR - Capitalisation » |
| Sustainable Asian Cities Bond | 8 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic HKD MD - Distribution » |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | 14 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « I Plus - Capitalisation » |
| Euro Bond | 18 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « K - Capitalisation » |
| Euro Corporate Bond | 18 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « K - Capitalisation » |
| Euro Money Market | 18 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic Plus - Distribution » |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | 22 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic H EUR - Capitalisation » |
| Local Emerging Bond | 22 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « X EUR - Capitalisation » |
| Inclusive Growth | 22 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « K - Capitalisation » |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | 22 septembre 2023 | Activation de la classe d'actions « K - Capitalisation » |
| Global Bond Opportunities | 2 octobre 2023 | Activation de la classe d'actions « Classic USD MD - Distribution » |
| Euro Medium Term Bond | 4 octobre 2023 | Activation de la classe d'actions « K - Capitalisation » |
| Green Tigers | 13 octobre 2023 | Activation de la classe d'actions « UI14 - Capitalisation » |
| Euro Government Bond | 2 novembre 2023 | Activation de la classe d'actions « K - Capitalisation » |
| US Small Cap | 17 novembre 2023 | Activation de la classe d'actions « U16 - Capitalisation » |
| USD Money Market | 24 novembre 2023 | Activation de la classe d'actions « U17 - Capitalisation » |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | 6 décembre 2023 | Activation de la classe d'actions « XH EUR - Capitalisation » |
| Euro High Yield Bond | 13 décembre 2023 | Activation de la classe d'actions « I Plus - Capitalisation » |
| USD Short Duration Bond | 21 décembre 2023 | Activation de la classe d'actions « Privilege H EUR - Capitalisation » |
| SMaRT Food | 7 décembre 2023 | Activation des classes d'actions « Classic CHF - Capitalisation » et « Privilege CHF - Capitalisation » |
| US Small Cap | 22 décembre 2023 | Activation de la classe d'actions « I - Distribution » |

c) Opération de fractionnement

Historiquement, une approche « multidevises » (telle que plus amplement décrite dans le prospectus du Fonds) était proposée par la Société et mise en œuvre au sein de plusieurs classes d'actions.

Il a cependant été décidé de supprimer cette possibilité de recourir à l'approche « multidevises ». Par conséquent, le Conseil d'Administration de la Société a décidé, conformément à l'article 34 des statuts de la Société, de fractionner les classes d'actions impactées.

A la suite de ce fractionnement, les actionnaires détenant des actions des classes d'actions impactées et bénéficiant de cette approche « multidevises » ont reçu des actions d'une classe d'actions présentant les mêmes caractéristiques que celle dont ils étaient actionnaires, à la différence près que la devise de référence de la nouvelle classe d'actions est identique à l'« autre devise d'évaluation » initialement choisie par l'actionnaire (en lieu et place de la devise de référence de la classe d'actions).

Le ratio de fractionnement étant de 1:1, les actionnaires ont reçu le même nombre d'actions que celui qu'ils détenaient avant l'opération de fractionnement.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

La date des derniers ordres de souscription, de conversion et de rachat, la date d'effet de l'opération de fractionnement et les classes d'actions concernées par l'opération de fractionnement sont reprises ci-dessous :

| Compartiment | Classe d'actions impactée par l'opération de fractionnement | Autre devise d'évaluation | Nouvelle classe d'actions après l'opération de fractionnement | Date des derniers ordres de souscription, de conversion et de rachat | Date d'effet de l'opération de fractionnement |
|---|---|---------------------------|---|--|---|
| Aqua | « Privilège - Capitalisation » | USD | « Privilège USD - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Aqua | « I - Capitalisation » | USD | « I USD - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Brazil Equity | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Brazil Equity | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| China A-Shares | « Classic - Capitalisation » | HKD | « Classic HKD - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| China A-Shares | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| China Equity | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| China Equity | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| China Equity | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| China Equity | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| Climate Impact | « Classic - Capitalisation » | USD | « Classic USD - Capitalisation » | 13-nov-2023 | 17-nov-23 |
| Consumer Innovators | « Classic - Distribution » | USD | « Classic USD - Distribution » | 13-nov-2023 | 17-nov-23 |
| Consumer Innovators | « N - Capitalisation » | USD | « N USD - Capitalisation » | 13-nov-2023 | 17-nov-23 |
| Disruptive Technology | « N - Capitalisation » | USD | « N USD - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Disruptive Technology | « Privilège - Capitalisation » | USD | « Privilège USD - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Emerging Bond | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Emerging Bond | « X - Capitalisation » | EUR | « X EUR - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Emerging Bond Opportunities | « Classic - Distribution » | GBP | « Classic GBP - Distribution » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Emerging Bond Opportunities | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Emerging Equity | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Emerging Equity | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Emerging Equity | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Emerging Equity | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Energy Transition | « Classic - Distribution » | GBP | « Classic GBP - Distribution » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Energy Transition | « I - Capitalisation » | USD | « I USD - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Energy Transition | « N - Capitalisation » | USD | « N USD - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Energy Transition | « Privilège - Capitalisation » | USD | « Privilège USD - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Europe Equity | « N - Capitalisation » | CHF | « N CHF - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Europe Real Estate Securities | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Europe Small Cap | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| Europe Small Cap | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| Global Convertible | « X - Capitalisation » | EUR | « X EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Global Environment | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Global Environment | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Global Inflation-Linked Bond | « Classic - Capitalisation » | USD | « Classic USD - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Green Tigers | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Green Tigers | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Green Tigers | « X - Capitalisation » | EUR | « X EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Health Care Innovators | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| India Equity | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| India Equity | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Japan Equity | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Japan Equity | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Japan Equity | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Japan Small Cap | « Classic - Capitalisation » | USD | « Classic USD - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Japan Small Cap | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Japan Small Cap | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Latin America Equity | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe d'actions impactée par l'opération de fractionnement | Autre devise d'évaluation | Nouvelle classe d'actions après l'opération de fractionnement | Date des derniers ordres de souscription, de conversion et de rachat | Date d'effet de l'opération de fractionnement |
|--|---|---------------------------|---|--|---|
| Latin America Equity | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| Local Emerging Bond | « Classic - Distribution » | GBP | « Classic GBP - Distribution » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| Nordic Small Cap | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Nordic Small Cap | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| RMB Bond | « Classic - Capitalisation » | EUR | « Classic EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| RMB Bond | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| RMB Bond | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| Sustainable Global Corporate Bond | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Sustainable Global Corporate Bond | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 13-nov-23 | 17-nov-23 |
| Sustainable Global Equity | « Classic - Capitalisation » | EUR | « Classic EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Global Equity | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Global Equity | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Global Equity | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Global Equity | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Global Equity | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Global Equity | « X - Capitalisation » | EUR | « X EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | « Classic - Capitalisation » | NOK | « Classic NOK - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | « I - Capitalisation » | USD | « I USD - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | « N - Capitalisation » | USD | « N USD - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| Sustainable US Multi-Factor Equity | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable US Multi-Factor Equity | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | « Classic - Distribution » | GBP | « Classic GBP - Distribution » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 11-sept-23 | 15-sept-23 |
| US Growth | « Classic - Capitalisation » | SEK | « Classic SEK - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| US Growth | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| US Growth | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| US Mid Cap | « Classic - Distribution » | EUR | « Classic EUR - Distribution » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| US Mid Cap | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 16-oct-23 | 20-oct-23 |
| US Small Cap | « I - Capitalisation » | EUR | « I EUR - Capitalisation » | 18-sept-23 | 22-sept-23 |
| USD Short Duration Bond | « Classic - Capitalisation » | EUR | « Classic EUR - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| USD Short Duration Bond | « N - Capitalisation » | EUR | « N EUR - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |
| USD Short Duration Bond | « Privilège - Capitalisation » | EUR | « Privilège EUR - Capitalisation » | 9-oct-23 | 13-oct-23 |

Note 2 - Principales méthodes comptables

a) Valeur nette d'inventaire

Le présent rapport annuel est préparé sur la base de la dernière valeur nette d'inventaire technique (ci-après « VNI ») calculée pour les besoins des états financiers au 31 décembre 2023.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Il convient de noter que depuis la publication des dernières VNI officielles des compartiments « Russia Equity » (VNI suspendue) et « Europe Emerging Equity » (liquidé le 3 juillet 2023), respectivement le 25 février 2022 et le 28 février 2022, le Conseil d'Administration a décidé d'ajuster l'évaluation de certains actifs russes afin de préserver la juste évaluation de ces deux compartiments. Une valorisation nulle a notamment été attribuée à l'ensemble des ADR, GDR et titres russes en devise locale détenus en portefeuille, en raison respectivement de l'absence de négociation/la suspension des cotations et de la fermeture de la bourse de Moscou aux non-résidents russes. Il a également été décidé, depuis le 1 mars 2022 et jusqu'à nouvel ordre, de renoncer aux commissions de gestion dues à la Société de Gestion. Le Conseil d'Administration reste attentif à l'évolution de la situation sur les marchés locaux et internationaux et prend toutes les mesures appropriées pour protéger les investisseurs.

b) Globalisation des différents compartiments

Les états financiers (combinés) de BNP Paribas Funds sont établis en EUR en convertissant les états financiers des compartiments libellés dans d'autres devises que l'EUR au taux de change en vigueur à la clôture de l'exercice.

c) Conversion des devises

Les comptes de chaque compartiment sont tenus dans la devise d'expression de la valeur nette d'inventaire et les états financiers sont établis dans cette même devise.

Le prix d'acquisition des titres achetés dans une devise autre que celle du compartiment est converti dans cette devise sur la base du taux de change en vigueur à la date d'acquisition des titres.

Les revenus et dépenses exprimés dans une devise autre que celle du compartiment sont convertis dans cette devise sur la base du taux de change en vigueur à la date de la transaction.

A la date de clôture, les valeurs de marché des titres (déterminées selon la méthode décrite ci-après), les créances, dépôts bancaires et dettes libellés dans une devise autre que celle du compartiment sont convertis dans cette devise sur la base du taux de change en vigueur à cette date, les écarts de change résultant de la conversion des titres, créances, dépôts bancaires et dettes étant inclus dans le résultat net de l'exercice.

d) Présentation des états financiers

Les états financiers sont établis sur la base de la dernière valeur nette d'inventaire calculée au cours de l'exercice. Conformément au prospectus, les valeurs nettes d'inventaire ont été calculées en fonction des derniers taux de change connus à la date du calcul. Les prix de marché et taux de change sont les derniers disponibles au 31 décembre 2023. Ce principe a été appliqué de façon uniforme et cohérente à tous les compartiments. A titre d'information, un certain délai est nécessaire avant que des prix indicatifs soient disponibles pour certains titres illiquides, de sorte que, pour ces titres, il s'est avéré impossible pour raisons matérielles d'utiliser des prix au 31 décembre 2023 aux fins du calcul des dernières valeurs nettes d'inventaire de l'exercice.

Toutefois, ces valeurs nettes d'inventaire n'auraient pas été sensiblement différentes de celles présentées dans le rapport annuel.

L'état des opérations et des changements des actifs nets couvre l'exercice du 1 janvier 2023 au 31 décembre 2023.

e) Evaluation du portefeuille-titres

L'évaluation de tous les titres cotés en bourse ou sur tout autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et accessible au public, est basée sur le dernier cours de clôture connu le Jour d'Evaluation et, si les titres concernés sont négociés sur plusieurs marchés, sur le dernier cours de clôture connu sur le marché principal sur lequel ces titres sont négociés. Si le dernier cours de clôture connu n'est pas représentatif, l'évaluation se basera sur le prix de vente probable, estimé avec prudence et en toute bonne foi par le Conseil d'Administration.

Le Conseil d'Administration recourt à cette option pour l'évaluation des titres cotés sur les marchés d'Asie de l'Est, d'Asie du Sud, d'Asie du Sud-Est et d'Océanie. Le dernier cours de clôture connu mentionné plus haut est alors ajusté en suivant une méthode vérifiée par la Société de Gestion afin de refléter un juste prix des actifs concernés.

Les titres qui ne sont pas cotés ou négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé en fonctionnement régulier, reconnu et accessible au public seront évalués sur la base du prix de vente probable estimé avec prudence et en toute bonne foi par un professionnel compétent mandaté à cette fin par le Conseil d'Administration.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Si les pratiques de marché l'autorisent, les actifs liquides, les instruments du marché monétaire et tous les autres instruments peuvent être évalués à leur valeur nominale majorée des intérêts courus ou selon la méthode de l'amortissement linéaire. Toute décision d'évaluer les actifs du portefeuille en utilisant la méthode de l'amortissement linéaire doit être approuvée par le Conseil d'Administration qui enregistrera les raisons d'une telle décision. Le Conseil d'Administration mettra en place les vérifications et les contrôles appropriés pour l'évaluation des instruments.

La valeur des parts ou des actions d'organismes de placement collectif sera calculée sur la base de la valeur nette d'inventaire la plus récente disponible le Jour d'évaluation. Si ce cours n'est pas représentatif, l'évaluation se basera sur le prix de vente probable, estimé avec prudence et en toute bonne foi par le Conseil d'Administration.

f) Evaluation des contrats de change à terme

Les contrats de change à terme restant ouverts à la date de clôture sont évalués par référence au taux de change correspondant à l'échéance résiduelle du contrat. Les plus-values et moins-values non réalisées, le cas échéant, sont prises en compte dans le résultat des opérations.

Pour calculer les positions nettes par devise, les positions sont converties sur la base du taux de change correspondant à l'échéance résiduelle du contrat.

L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

g) Evaluation des instruments financiers

Les contrats futures sur instruments financiers sont évalués à leur dernier prix de marché connu. Les autres instruments financiers sont évalués sur la base du prix auquel la position pourrait être liquidée, en fonction des conditions de marché en vigueur à la date d'évaluation.

L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

Pour calculer les positions nettes par devise sur instruments financiers, les positions sont converties sur la base du taux de change en vigueur à la date de clôture.

h) Evaluation des Credit Default Swaps

La valeur d'un Credit Default Swap (CDS) sera déterminée en comparant la valeur de la branche du swap relative à la protection et celle de la branche relative à la prime. La valeur de la branche relative à la prime est obtenue en actualisant les flux de prime futurs à l'aide du taux d'actualisation ajusté au risque adéquat. La valeur de la branche relative à la protection correspond à la valeur actualisée de la perte attendue inhérente au contrat. Les probabilités de défaut utilisées pour calculer la perte attendue sont extrapolées à partir de la structure des taux de swap comparables observés sur le marché. Les taux de swap comparables observés sur le marché seront obtenus auprès d'un échantillon de contreparties.

L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

Notes aux états financiers au 31/12/2023

i) Evaluation des swaps sur rendement total et des swaps de performance

Un Swap sur rendement total (TRS) est un accord bilatéral selon lequel chaque partie convient d'échanger, contre un taux fixe ou variable, des paiements basés sur la performance d'un instrument sous-jacent représenté par un titre, une matière première, un panier de titres ou un indice. L'une des parties paie le rendement total d'un actif de référence spécifique et reçoit des paiements réguliers en échange. La performance totale inclut les gains et les pertes sur le sous-jacent, ainsi que tout intérêt ou dividende généré sur la durée du contrat en fonction du type de sous-jacent. Les flux de trésorerie à échanger sont calculés en référence à un montant ou à une quantité notionnels convenus.

Les TRS sont évalués au prix du marché à chaque date de calcul de la VNI.

L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

j) Evaluation des options

Les contrats d'option négociés de gré à gré sont évalués aux cours auxquels la position pourrait être liquidée en fonction des conditions de marché en vigueur à la date d'évaluation. La valeur de liquidation des contrats d'option négociés sur des marchés réglementés sera basée sur le dernier prix de règlement disponible de ces contrats sur les marchés réglementés sur lesquels ils sont négociés par la Société, étant entendu que si un contrat d'option ne peut pas être liquidé le jour où les actifs nets sont évalués, la base qui servira à déterminer la valeur de liquidation de ce contrat sera déterminée par le Conseil d'Administration de façon juste et raisonnable.

La valeur de marché des options figure dans l'Etat des actifs nets. L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée à la rubrique « Options à la valeur de marché ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

k) Evaluation des prêts de titres et des accords de prise et mise en pension

Les prêts de titres génèrent une rémunération au profit du compartiment selon les contrats et sont comptabilisés dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets sous la rubrique « Revenus sur titres et avoirs, nets ».

Les titres faisant l'objet d'un prêt figurent à l'actif net du compartiment concerné et sont présentés à leur valeur de marché.

Les opérations de prise en pension (ou de mise en pension) sont assimilées à des opérations d'emprunt (ou de prêt) garanties par les titres sous-jacents. Il s'agit d'opérations par lesquelles le cédant cède à une autre personne (le cessionnaire) la propriété de titres et aux termes desquelles le cédant et le cessionnaire s'engagent respectivement et irrévocablement le premier à les reprendre, le second à les rétrocéder, pour un prix et à une date convenus.

Les accords de prise en pension sont évalués à leur prix d'acquisition exprimé dans la devise d'origine, sans égard à la valeur de marché des titres sous-jacents, le prorata d'intérêts courus depuis la date d'acquisition figurant sous la rubrique « Autres actifs » de l'Etat des actifs nets.

Les accords de mise en pension sont évalués à leur valeur de marché.

l) Evaluation des swaps d'inflation

Les swaps d'inflation (ILS) sont des accords bilatéraux permettant aux investisseurs cherchant à protéger leurs placements de s'assurer un rendement corrélé à l'inflation sur la base d'un indice d'inflation.

L'acheteur d'inflation (« receveur d'inflation ») paie un taux fixe ou variable prédéterminé (moins un spread). En échange, le vendeur d'inflation (« payeur d'inflation ») lui verse un ou plusieurs paiements liés à l'inflation.

Le principal risque lié à un swap d'inflation réside dans sa sensibilité aux taux d'intérêt et à l'inflation : le payeur d'inflation s'expose au risque d'inflation lié aux changements susceptibles d'influer sur la courbe des prix. Le payeur est également exposé à un risque de taux d'intérêt lié à l'évolution de la courbe des taux nominaux. Pour évaluer les swaps d'inflation, une courbe « forward zero coupon » (ajustée pour tenir compte de l'inflation saisonnière) est créée, ce qui permet de calculer les flux de trésorerie futurs liés à l'inflation.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

m) Evaluation des swaps de taux d'intérêt

Les swaps de taux d'intérêt (IRS) sont évalués sur la base de la différence entre la valeur de tous les intérêts futurs payables par la Société à la contrepartie à la date de valorisation au taux « zero coupon swap » correspondant à l'échéance de ces paiements et la valeur de tous les intérêts futurs payables par la contrepartie à la Société à la date de valorisation au taux « zero coupon swap » correspondant à l'échéance de ces paiements.

L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

n) Evaluation des options sur spread CMS (Constant Maturity Swap, swap à échéance constante)

L'équipe chargée de l'évaluation des instruments de gré à gré est responsable de l'évaluation quotidienne des options sur spread CMS grâce à l'outil BVAL de Bloomberg - modèle d'évaluation spécifique DLIB (Bloomberg Derivatives Library). Le modèle d'évaluation utilisé, conformément à la pratique du marché, est le modèle gaussien (tenant compte de la corrélation et des cotations des courtiers). Les évaluations en découlant sont comparées aux évaluations fournies quotidiennement par les contreparties.

L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

o) Evaluation des Contracts for Difference

Les Contracts for Difference (CFD) sont évalués par référence à la valeur de marché de l'actif sous-jacent, en tenant compte des coûts inhérents à la transaction. L'appréciation/(dépréciation) non réalisée est indiquée dans l'Etat des actifs nets à la rubrique « Plus-value nette non réalisée sur instruments financiers » ou « Moins-value nette non réalisée sur instruments financiers ». Les plus-values/(moins-values) réalisées et les variations de l'appréciation/(la dépréciation) non réalisée qui en découlent sont incluses dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets, respectivement sous « Résultat net réalisé sur instruments financiers » et « Variation de la plus-value/(moins-value) nette non réalisée sur instruments financiers ».

p) Echéance moyenne des obligations à taux variable

Ce ne sont pas les échéances indiquées dans la description des titres du portefeuille-titres qui sont utilisées pour calculer l'échéance moyenne, mais bien les dates de remboursement anticipé.

q) Intérêts

Les intérêts sont comptabilisés au prorata, après déduction des éventuelles retenues à la source applicables. En raison des taux d'intérêt négatifs observés sur l'exercice, les revenus des obligations repris au compte « Revenus sur titres et avoirs, nets » peuvent être négatifs.

r) Comparatifs

S'agissant des compartiments impliqués dans des fusions par absorption durant l'exercice, il convient de noter que l'actif net des compartiments ou des fonds absorbés a été comptabilisé par l'intermédiaire d'une souscription dans les compartiments absorbants aux dates de fusion. Par conséquent, la ligne « Total des souscriptions/(rachats) » sur dans l'« Etat des opérations et des changements des actifs nets » reprend l'actif net des compartiments ou des fonds absorbés aux dates de fusion.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

s) Répartition géographique

La répartition géographique du portefeuille-titres est basée sur le pays émetteur.

t) Titres « A communiquer » (To Be Announced)

Les « titres adossés à des prêts hypothécaires à communiquer » sont régis par les pratiques de marché en vigueur et applicables aux titres garantis par des hypothèques, selon lesquelles une partie s'engage à acheter/vendre un panier de prêts hypothécaires à un prix fixe et à une date ultérieure.

Au moment de l'achat/de la vente, le titre n'est pas connu, même si ses principales caractéristiques le sont. Même si un prix est défini au moment de l'achat/de la vente, la valeur nominale finale n'est pas encore fixée.

Les positions sur des « titres adossés à des prêts hypothécaires à communiquer » figurent dans le portefeuille de titres au 31 décembre 2023.

A la date de clôture, l'achat/la vente de ces titres n'avait pas encore été réglé. Par conséquent, les montants à verser/à recevoir sur les titres figurent à la rubrique « Autres passifs »/« Autres actifs » de l'« Etat des actifs nets ».

u) Investissements croisés

La valeur des investissements croisés des compartiments n'a pas été déduite dans le calcul de la somme globale des actifs nets de la Société.

La valeur totale de ces investissements croisés au 31 décembre 2023 s'élevait à :

| Compartiments investissant dans d'autres compartiments de BNP PARIBAS FUNDS | Compartiments détenus par d'autres compartiments de BNP PARIBAS FUNDS | Devise du compartiment investissant | Valeur de marché (en EUR) |
|---|---|-------------------------------------|---------------------------|
| Emerging Bond | Sustainable Asian Cities Bond | USD | 3 867 255 |
| Emerging Bond Opportunities | RMB Bond | USD | 12 158 367 |
| Emerging Bond Opportunities | Sustainable Asian Cities Bond | USD | 2 641 053 |
| Enhanced Bond 6M | Euro Flexible Bond | EUR | 15 049 172 |
| Enhanced Bond 6M | Global Enhanced Bond 36M | EUR | 9 846 410 |
| Euro Bond Opportunities | Sustainable Asian Cities Bond | EUR | 2 829 416 |
| Euro Corporate Bond | Euro Corporate Green Bond | EUR | 7 697 905 |
| Euro Corporate Bond Opportunities | Euro High Yield Bond | EUR | 1 227 940 |
| Euro Corporate Bond Opportunities | Euro High Yield Short Duration Bond | EUR | 1 257 694 |
| Euro Flexible Bond | Euro High Yield Bond | EUR | 130 560 |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | Euro High Yield Bond | EUR | 7 957 938 |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | Euro High Yield Short Duration Bond | EUR | 5 435 641 |
| Europe High Conviction Bond | Euro Inflation-Linked Bond | EUR | 276 |
| Global Bond Opportunities | RMB Bond | EUR | 22 307 708 |
| Global Bond Opportunities | Sustainable Asian Cities Bond | EUR | 3 877 725 |
| Global Enhanced Bond 36M | Sustainable Asian Cities Bond | EUR | 659 037 |
| Local Emerging Bond | RMB Bond | USD | 18 343 594 |
| Multi-Asset Opportunities | Green Bond | USD | 184 971 |
| Multi-Asset Thematic | Aqua | EUR | 5 430 869 |
| Multi-Asset Thematic | Disruptive Technology | EUR | 7 991 198 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiments investissant dans d'autres compartiments de BNP PARIBAS FUNDS | Compartiments détenus par d'autres compartiments de BNP PARIBAS FUNDS | Devise du compartiment investissant | Valeur de marché (en EUR) |
|---|---|-------------------------------------|---------------------------|
| Multi-Asset Thematic | Energy Transition | EUR | 1 705 587 |
| Multi-Asset Thematic | Global Environment | EUR | 7 023 447 |
| Multi-Asset Thematic | Green Bond | EUR | 26 930 022 |
| Multi-Asset Thematic | Health Care Innovators | EUR | 5 503 565 |
| Multi-Asset Thematic | Inclusive Growth | EUR | 6 550 742 |
| Multi-Asset Thematic | SMaRT Food | EUR | 1 617 054 |
| Multi-Asset Thematic | Social Bond | EUR | 19 111 939 |
| Multi-Asset Thematic | Sustainable Asian Cities Bond | EUR | 6 683 141 |
| Sustainable Euro Bond | Euro Corporate Green Bond | EUR | 4 618 743 |
| Sustainable Euro Bond | Social Bond | EUR | 9 395 370 |
| Sustainable Euro Corporate Bond | Euro Corporate Green Bond | EUR | 21 994 013 |
| Sustainable Euro Corporate Bond | Social Bond | EUR | 19 174 223 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Euro Corporate Green Bond | USD | 7 697 904 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Sustainable Global Multi-Factor Equity | EUR | 9 918 663 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Emerging Markets Climate Solutions | EUR | 10 375 115 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Energy Transition | EUR | 8 393 305 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Global Environment | EUR | 26 023 036 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Green Bond | EUR | 24 883 237 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Green Tigers | EUR | 9 958 263 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Inclusive Growth | EUR | 18 187 354 |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Green Tigers | EUR | 1 466 616 |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Sustainable Enhanced Bond 12M | EUR | 17 674 624 |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond | EUR | 12 033 431 |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | EUR | 6 063 696 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Emerging Markets Climate Solutions | EUR | 8 268 653 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Energy Transition | EUR | 6 684 171 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Global Environment | EUR | 21 851 374 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Green Tigers | EUR | 7 923 412 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Inclusive Growth | EUR | 14 489 545 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Sustainable Euro Bond | EUR | 90 376 661 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Emerging Markets Climate Solutions | EUR | 4 205 066 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Energy Transition | EUR | 3 405 019 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Global Environment | EUR | 11 041 225 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Green Bond | EUR | 26 081 319 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Green Tigers | EUR | 4 035 597 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Inclusive Growth | EUR | 7 316 487 |
| Target Risk Balanced | Enhanced Bond 6M | EUR | 65 961 449 |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiments investissant dans d'autres compartiments de BNP PARIBAS FUNDS | Compartiments détenus par d'autres compartiments de BNP PARIBAS FUNDS | Devise du compartiment investissant | Valeur de marché (en EUR) |
|---|---|-------------------------------------|---------------------------|
| Target Risk Balanced | Sustainable Enhanced Bond 12M | EUR | 65 056 282 |
| | | Total : | 748 574 079 |

Les actifs nets à la fin de l'exercice (chiffres consolidés) seraient de 53 963 013 902 EUR sans prendre en compte la valeur des investissements croisés.

v) Provision pour performance technique

En vue d'atteindre l'objectif de gestion des fonds monétaires tel que défini dans le prospectus, la Société de Gestion peut être tenue, en tant que de besoin, de constituer des réserves sur la base de la performance de la valeur nette d'inventaire afin de réduire la volatilité de certains titres détenus en portefeuille. Cet ajustement ne peut pas dépasser 5 pb des actifs nets du fonds. Les réserves concernées seront réinvesties en fonction de la performance des actifs, ainsi que de la performance moyenne du portefeuille.

Les compartiments suivants sont concernés par cette provision :

- BNP Paribas Funds Euro Money Market
- BNP Paribas Funds USD Money Market

w) Swing Pricing

Un compartiment peut subir une réduction de sa valeur nette d'inventaire en raison d'achats, de ventes et/ou de conversions dans et hors de celui-ci à un prix qui ne reflète pas les frais de transaction liés aux opérations de portefeuille effectuées par le Gestionnaire financier afin de faire face à ces entrées ou sorties de liquidités. Afin d'atténuer cet effet et de renforcer la protection des actionnaires existants, le mécanisme connu sous le nom de « swing pricing » peut être appliqué à la discrétion du Conseil d'Administration de la Société.

Ce mécanisme de Swing Pricing peut être appliqué à un compartiment donné lorsque l'activité totale de son capital (c'est-à-dire le montant net des souscriptions et des rachats) dépasse un seuil prédéterminé défini en pourcentage de la valeur nette d'inventaire pour un Jour d'évaluation donné. La valeur nette d'inventaire du compartiment concerné peut alors être ajustée d'un certain montant (le « swing factor ») afin de compenser les frais de transaction attendus résultant de l'activité du capital. Le niveau des seuils, le cas échéant, sera déterminé sur la base de certains paramètres qui peuvent inclure la taille du compartiment, la liquidité du marché sous-jacent dans lequel il investit, la gestion de ses liquidités ou le type d'instrument utilisé pour gérer l'activité du capital. Le swing factor est basé, entre autres, sur les frais de transaction estimés des instruments financiers dans lesquels le compartiment concerné peut investir. Cet ajustement aura généralement pour effet d'augmenter la valeur nette d'inventaire en cas de souscriptions nettes dans le compartiment et de la diminuer en cas de rachats nets. Le swing pricing ne tient pas compte des circonstances spécifiques de chaque transaction individuelle d'un investisseur. Un comité interne ad hoc est chargé de la mise en œuvre et de la révision périodique des décisions opérationnelles liées au swing pricing. Ce comité est responsable des décisions relatives au swing pricing et de l'approbation des swing factors qui constituent la base des instructions permanentes prédéfinies.

En principe, le swing factor ne dépassera pas 1% de la valeur nette d'inventaire du compartiment concerné. Cette limite pourrait toutefois être relevée temporairement au-delà de ce niveau maximum lorsque cela s'avère nécessaire afin de protéger les intérêts des actionnaires, généralement dans des conditions de marché exceptionnelles, en cas de situations comme une pandémie mondiale, une crise financière, une crise géopolitique ou tout autre événement exceptionnel qui entraîne une nette dégradation de la liquidité.

Le mécanisme de Swing Pricing peut être appliqué à tous les compartiments de la Société.

Au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, les compartiments ci-dessous entraient dans le périmètre du mécanisme de Swing Pricing :

- Emerging Bond
- Emerging Bond Opportunities
- Enhanced Bond 6M
- Euro High Yield Bond
- Euro High Yield Short Duration Bond

Notes aux états financiers au 31/12/2023

- Euro Short Term Corporate Bond Opportunities
- Europe Convertible
- Europe Small Cap
- Europe Small Cap Convertible
- Global Convertible
- Global High Yield Bond
- Japan Small Cap
- Local Emerging Bond
- Nordic Small Cap
- Russia Equity
- Sustainable Enhanced Bond 12M
- US High Yield Bond

Au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023, les compartiments ci-dessous ont appliqué le Swing Pricing :

- Emerging Bond Opportunities
- Enhanced Bond 6M
- Euro Short Term Corporate Bond Opportunities
- Europe Small Cap Convertible
- Sustainable Enhanced Bond 12M

Au 31 décembre 2023, aucun des ces compartiments n'a eu recours au mécanisme de Swing Pricing.

Note 3 - Commissions de gestion et de conseil (maximum par an)

La commission annuelle maximale payable mensuellement est calculée sur la base de la valeur nette d'inventaire de chaque classe d'actions pour chaque compartiment lors du mois écoulé. Pour certains compartiments, une commission de gestion réduite a été prélevée au cours de l'exercice. La commission est versée à la Société de Gestion et sert à couvrir la rémunération des gestionnaires financiers et des distributeurs dans le cadre de la commercialisation des actions de la Société.

La commission de gestion applicable à la catégorie « Classic » s'applique à la catégorie « N » et à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « Classic » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « Privilege » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « Privilege » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « I » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « I » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « U » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « U » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « UP » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « UP » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « Life » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « Life » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « UI » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « UI » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « B » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « B » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « K » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant le terme « K » dans leur dénomination.

La commission de gestion applicable à la catégorie « X » s'applique également à toutes les sous-catégories et classes d'actions incluant la lettre « X » dans leur dénomination.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classic | Privilege | I | U | UP | Life | UI | B | K | X |
|--|-----------------------|----------------------|-----------------------|-------|-------|--------|----------------------|-------|-------|-----------------------|
| Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023) | 1,00% | 0,50% | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Aqua | 1,75% | 0,90% | 0,90% | 1,75% | S/O | 1,615% | 0,90% | 1,75% | 1,75% | 0,60% ⁽¹⁵⁾ |
| Asia High Yield Bond | 1,15% | 0,60% | 0,55% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Asia Tech Innovators | 1,75% | 0,90% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Belgium Equity | 1,25% | 0,60% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Brazil Equity | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| China A-Shares | 1,75% | 0,90% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| China Equity | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,75% | S/O |
| Climate Impact | 2,20% | 1,10% | 1,10% ⁽¹⁾ | 2,20% | S/O | S/O | S/O | S/O | 2,20% | 0,60% ⁽¹⁵⁾ |
| Consumer Innovators | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | 1,50% | S/O |
| Disruptive Technology | 1,50% | 0,75% | 0,75% ⁽²⁾ | S/O | 0,75% | S/O | 0,75% ⁽³⁾ | 1,50% | 1,50% | S/O |
| Ecosystem Restoration | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | 0,75% | S/O | S/O | S/O |
| Emerging Bond | 1,25% | 0,65% | 0,55% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,25% | S/O | S/O |
| Emerging Bond Opportunities | 1,50% | 0,75% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | S/O | S/O |
| Emerging Equity | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,75% | S/O | S/O |
| Emerging Markets Climate Solutions | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Energy Transition | 1,50% ⁽⁴⁾ | 0,75% ⁽⁵⁾ | 0,75% ⁽²⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | 1,50% | S/O |
| Enhanced Bond 6M | 0,50% | 0,25% | 0,20% ⁽⁶⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | 1,50% | 0,75% | 0,75% ⁽¹⁸⁾ | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,75% | S/O |
| Euro Bond Opportunities | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Corporate Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,75% | S/O |
| Euro Corporate Bond Opportunities | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,75% | S/O |
| Euro Corporate Green Bond | 0,65% | 0,35% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Defensive Equity | 1,75% | 0,90% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | S/O |
| Euro Flexible Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Government Bond | 0,70% | 0,35% | 0,25% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,70% | S/O |
| Euro High Quality Government Bond (liquidé le 23 mai 2023) | 0,60% | 0,30% | 0,25% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro High Yield Bond | 1,20% | 0,60% | 0,55% ⁽¹⁶⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,20% | S/O |
| Euro High Yield Short Duration Bond | 0,80% | 0,40% | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Inflation-Linked Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Medium Term Bond | 0,50% | 0,25% | 0,20% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,50% | S/O |
| Euro Money Market | 0,50% ⁽¹⁹⁾ | 0,25% | 0,20% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | 0,90% | 0,45% | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,90% | S/O |
| Europe Convertible | 1,20% | 0,65% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Europe Emerging Equity (liquidé le 3 juillet 2023) | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Europe Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% ⁽²⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Europe Growth | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Europe High Conviction Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% ⁽⁷⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Europe Real Estate Securities | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Europe Small Cap | 1,75% | 0,90% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | 0,85% | S/O | S/O | S/O |
| Europe Small Cap Convertible | 1,20% | 0,65% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Flexible Global Credit | 0,80% | 0,40% | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Global Absolute Return Multi-Factor Bond | 0,75% | 0,40% | 0,35% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classic | Privilege | I | U | UP | Life | UI | B | K | X |
|---|-----------------------|-----------------------|-----------------------|-------|-------|--------|-------|-------|-------|-----------------------|
| Global Bond Opportunities | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,75% | S/O |
| Global Climate Solutions | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Global Convertible | 1,20% | 0,65% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Global Enhanced Bond 36M | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Global Environment | 1,75% | 0,90% | 0,85% ⁽⁸⁾ | S/O | S/O | S/O | 0,85% | 1,75% | 1,75% | 0,60% ⁽¹⁵⁾ |
| Global High Yield Bond | 1,20% | 0,60% | 0,55% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,20% | 1,20% | S/O |
| Global Inflation-Linked Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | 0,25% | S/O | S/O | S/O |
| Green Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,75% | S/O |
| Green Tigers | 1,75% | 0,90% | 0,90% | 1,75% | S/O | S/O | 0,90% | S/O | S/O | 0,60% ⁽¹⁵⁾ |
| Harmony (fusionné le 29 juin 2023) | 0,90% | S/O | 0,40% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,90% | S/O |
| Health Care Innovators | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | S/O |
| Inclusive Growth | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| India Equity | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Japan Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,60% ⁽¹⁵⁾ |
| Japan Small Cap | 1,85% ⁽²⁰⁾ | 0,95% ⁽²⁰⁾ | 0,95% ⁽²⁰⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,60% ⁽¹⁵⁾ |
| Latin America Equity | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Local Emerging Bond | 1,40% | 0,70% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,40% | S/O | S/O |
| Multi-Asset Opportunities (anciennement Emerging Multi-Asset Income) | 1,25% | 0,65% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,25% | S/O | S/O |
| Multi-Asset Thematic | 1,25% | 0,65% | 0,60% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Nordic Small Cap | 1,75% | 0,90% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| RMB Bond | 1,00% | 0,50% | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Russia Equity (VNI suspendue) | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,75% | S/O | S/O |
| Seasons | 1,00% | 0,50% | 0,50% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,00% | S/O |
| SMaRT Food | 1,75% | 0,90% | 0,85% | 1,75% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | 1,75% | 0,60% ⁽¹⁵⁾ |
| Social Bond | 0,65% | 0,35% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | 1,50% | 0,75% ⁽¹⁷⁾ | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Asian Cities Bond | 0,90% | 0,45% | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | 0,80% | 0,50% | 0,40% ⁽⁶⁾ | 0,80% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Euro Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Euro Corporate Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Euro Low Vol Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond | 0,50% | 0,25% | 0,25% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,50% | S/O |
| Sustainable Euro Multi-Factor Equity | 1,05% | 0,50% | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Europe Dividend | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Europe Multi-Factor Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% ⁽²⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | S/O |
| Sustainable Europe Value | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Global Corporate Bond | 0,75% | 0,40% | 0,30% | S/O | S/O | S/O | S/O | 0,75% | 0,75% | S/O |
| Sustainable Global Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | 1,385% | S/O | 1,50% | 1,50% | S/O |
| Sustainable Global Low Vol Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% ⁽²⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | 1,50% | S/O |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | 0,50% | 0,25% | 0,25% ⁽⁷⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Global Multi-Factor Equity | 1,50% | 0,75% | 0,65% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | S/O |
| Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond | 0,80% | 0,40% | 0,35% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable Japan Multi-Factor Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classic | Privilege | I | U | UP | Life | UI | B | K | X |
|--|-----------------------|-----------------------|----------------------|-------|-----|------|-----|-------|-------|-----|
| Sustainable Multi-Asset Balanced | 1,30% ⁽⁹⁾ | 0,65% ⁽¹⁰⁾ | 0,50% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,30% | S/O |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | 1,00% | 0,50% | 0,50% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,00% | S/O |
| Sustainable Multi-Asset Growth | 1,40% ⁽¹¹⁾ | 0,70% ⁽¹²⁾ | 0,50% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,40% | S/O |
| Sustainable Multi-Asset Stability | 1,10% ⁽¹³⁾ | 0,55% ⁽¹⁴⁾ | 0,40% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,10% | S/O |
| Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | 0,50% | 0,25% | 0,25% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Sustainable US Multi-Factor Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% ⁽²⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,50% | S/O |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | 1,50% | 0,75% | 0,75% ⁽²⁾ | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Target Risk Balanced | 1,10% | 0,55% | 0,55% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| Turkey Equity | 1,75% | 0,90% | 0,90% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| US Growth | 1,50% | 0,75% | 0,75% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| US High Yield Bond | 1,20% | 0,60% | 0,55% | S/O | S/O | S/O | S/O | 1,20% | 1,20% | S/O |
| US Mid Cap | 1,75% | 0,90% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| US Small Cap | 1,75% | 0,90% | 0,85% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| USD Money Market | 0,50% ⁽¹⁹⁾ | 0,25% | 0,20% | 0,50% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |
| USD Short Duration Bond | 0,50% | 0,25% | 0,20% | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O | S/O |

(1) 0,85% pour la catégorie « I Plus ».

(2) 0,60% pour la catégorie « I Plus ».

(3) Avec un Droit d'entrée spécifique de 3% maximum payable par l'investisseur autorisé.

(4) 1,45% pour « Classic Solidarity ».

(5) 0,70% pour « Privilege Solidarity ».

(6) 0,15% pour la catégorie « I Plus ».

(7) 0,20% pour la catégorie « I Plus ».

(8) 0,70% pour la catégorie « I Plus ».

(9) 1,25% pour « Classic Solidarity BE ».

(10) 0,60% pour « Privilege Solidarity BE ».

(11) 1,35% pour « Classic Solidarity BE ».

(12) 0,65% pour « Privilege Solidarity BE ».

(13) 1,05% pour « Classic Solidarity BE ».

(14) 0,50% pour « Privilege Solidarity BE ».

(15) Payée en intégralité uniquement aux entités de gestion n'appartenant pas au Groupe.

(16) 0,45% pour la catégorie « I Plus ».

(17) 0,62% pour la catégorie « Privilege Plus ».

(18) 0,75% pour la catégorie « I Plus ».

(19) 0,40% pour la catégorie « Classic Plus ».

(20) Jusqu'au 14 mai 2023 : 1,75% pour la classe « Classic », 0,90% pour la classe « Privilege » et 0,85% pour la classe « I »

Une commission de conseil maximum de 0,15% a été appliquée à toutes les classes d'actions du compartiment Japan Small Cap, à l'exception de la classe d'actions « X » (jusqu'au 14 mai 2023).

Une commission indirecte maximale de 1,00% est appliquée aux compartiments Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023), Sustainable Multi-Asset Balanced, Sustainable Multi-Asset Growth et Target Risk Balanced.

Une commission indirecte maximale de 0,50% est appliquée aux compartiments Harmony (fusionné le 29 juin 2023), Multi-Asset Thematic, Sustainable Multi-Asset Flexible et Sustainable Multi-Asset Stability.

Une commission de bienfaisance de 0,05% est appliquée pour les classes d'actions « Classic Solidarity », « Classic Solidarity BE », « Privilege Solidarity » et « Privilege Solidarity BE » des compartiments Energy Transition, Sustainable Multi-Asset Balanced, Sustainable Multi-Asset Growth et Sustainable Multi-Asset Stability.

Un compartiment ne peut investir dans un OPCVM, ou un autre OPC, appliquant une commission de gestion supérieure à 3,00% par an.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

La commission de gestion maximale appliquée aux compartiments sous-jacents est fixée comme suit :

| Nom du titre | Commission de gestion |
|--|-----------------------|
| BNP Paribas Easy € Corp Bond SRI PAB Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy € Corp Bond SRI PAB UCITS ETF - CAP | 0,08% |
| BNP Paribas Easy € Corp Bond SRI PAB 1-3Y Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy € High Yield SRI Fossil Free UCITS ETF - CAP | 0,13% |
| BNP Paribas Easy ECPI Circular Economy Leaders Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy ECPI Circular Economy Leaders UCITS ETF - CAP | 0,18% |
| BNP Paribas Easy ECPI Global ESG Blue Economy Track X - DIS | 0,00% |
| BNP Paribas Easy ECPI Global ESG Blue Economy UCITS ETF - CAP | 0,18% |
| BNP Paribas Easy ECPI Global ESG Hydrogen Economy Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy Energy & Metals Enhanced Roll UCITS ETF RH EUR - CAP | 0,26% |
| BNP Paribas Easy FTSE EPRA Nareit Developed Europe ex UK Green CTB UCITS ETF - CAP | 0,28% |
| BNP Paribas Easy FTSE EPRA/NAREIT Developed Europe UCITS ETF QD - DIS | 0,28% |
| BNP Paribas Easy JPM ESG EMBI Global Diversified Composite Track IH EUR - CAP | 0,07% |
| BNP Paribas Easy JPM ESG Green Social & Sustainability IG EUR Bond UCITS ETF - CAP | 0,13% |
| BNP Paribas Easy JPM ESG Green Social & Sustainability IG EUR Bond Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy MSCI Emerging ESG Filtered Min TE UCITS ETF EUR - CAP | 0,13% |
| BNP Paribas Easy MSCI Emerging SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF - CAP | 0,18% |
| BNP Paribas Easy MSCI Emerging SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF EUR - CAP | 0,18% |
| BNP Paribas Easy MSCI Europe ESG Filtered Min TE UCITS ETF - CAP | 0,03% |
| BNP Paribas Easy MSCI Europe SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF - DIS | 0,13% |
| BNP Paribas Easy MSCI Europe SRI S-Series PAB 5% Capped Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy MSCI Europe SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF - CAP | 0,13% |
| BNP Paribas Easy MSCI Japan ESG Filtered Min TE UCITS ETF - CAP | 0,03% |
| BNP Paribas Easy MSCI Japan SRI S-Series PAB 5% Capped Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy MSCI Japan SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF - CAP | 0,13% |
| BNP Paribas Easy MSCI Japan SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF - DIS | 0,13% |
| BNP Paribas Easy MSCI North America ESG Filtered Min TE UCITS ETF - CAP | 0,03% |
| BNP Paribas Easy MSCI North America ESG Filtered Min TE Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy MSCI Pacific ex Japan ESG Filtered Min TE UCITS ETF - CAP | 0,03% |
| BNP Paribas Easy MSCI USA SRI S-Series PAB 5% Capped Track X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Easy MSCI USA SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF - CAP | 0,13% |
| BNP Paribas Easy MSCI World SRI S-Series PAB 5% Capped UCITS ETF EUR - CAP | 0,13% |
| BNP Paribas Funds Aqua X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Disruptive Technology X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Emerging Markets Climate Solutions X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Energy Transition X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Enhanced Bond 6M X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Global Environment X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Global Environment X - DIS | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Green Bond X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Green Tigers X EUR - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Health Care Innovators X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Inclusive Growth X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds SMaRT Food X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Social Bond X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Sustainable Asian Cities Bond X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Sustainable Enhanced Bond 12M X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Sustainable Euro Bond X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Funds Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas InstiCash EUR 3M I - CAP | 0,15% |
| THEAM QUANT - Cross Asset High Focus J - ACC | 0,40% |
| BNP Paribas Easy S&P 500 ESG UCITS ETF EUR - CAP | 0,03% |
| BNP Paribas Invest 3 MOIS X - CAP | 0,00% |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Nom du titre | Commission de gestion |
|------------------------------|-----------------------|
| BNP Paribas Mois ISR X - CAP | 0,00% |
| BNP Paribas Mois ISR I - CAP | 0,15% |
| BNP Paribas Money 3M I - CAP | 0,25% |

Note 4 - Commissions de distribution

Les commissions de distribution, calculées chaque jour d'évaluation et déduites mensuellement des actifs nets moyens d'un compartiment, d'une catégorie d'actions ou d'une classe d'actions, sont versées à la Société de gestion et servent à couvrir la rémunération des distributeurs, en complément de la part de la commission de gestion qu'ils reçoivent.

Note 5 - Commissions de performance : Méthode de calcul et tableau récapitulatif

La Société peut appliquer deux types de commission de performance :

1. Commission de performance relative :

La commission de performance est déterminée au titre de la période de performance et correspond au pourcentage (« taux de commission de performance ») de différence positive (« surperformance ») entre la performance annuelle de la classe d'actions et la performance annuelle calculée selon la méthode « High Water Mark (HWM) with Hurdle Rate or Benchmark ». Une provision pour commission de performance sera constituée chaque jour d'évaluation sur la base de l'actif net total de la classe d'actions ne faisant pas l'objet d'un facteur de swing (voir section « Swing Pricing » du prospectus) si la performance de la classe d'actions dépasse la performance calculée selon la méthode « High Water Mark (HWM) with Hurdle Rate or Benchmark ». La provision pour commission de performance sera ensuite ajustée chaque jour d'évaluation en fonction de la performance de la classe d'actions. En cas de sous-performance à la fin de la période de performance, ni le High Water Mark, ni le Hurdle Rate, ni le Benchmark ne seront réinitialisés. La période de référence de la performance correspondra dans ce cas à la durée de vie totale de la classe d'actions.

Période de performance : période sur laquelle la performance de la classe d'actions est mesurée, correspondant à l'exercice financier.

2. Commission de performance absolue :

Différence positive entre la VNI par action à la fin de l'exercice et le HWM de la classe d'actions ou le prix d'offre initial par action. Une provision pour commission de performance sera constituée chaque jour d'évaluation sur la base de l'actif net total de la classe d'actions ne faisant pas l'objet d'un facteur de swing (voir section « Swing Pricing » du prospectus) si la VNI par action dépasse le HWM. La provision pour commission de performance sera ensuite ajustée chaque jour d'évaluation en fonction de la performance de la classe d'actions. En cas de sous-performance à la fin de la période de performance, une perte peut être reportée sur une période maximale de 5 ans. Cela signifie qu'après 5 années consécutives sans commission de performance versée à la Société de Gestion, le HWM sera réinitialisé.

Le high water mark (HWM) correspond à la VNI la plus élevée du compartiment/de la catégorie/classe à la fin de tout exercice précédent au titre duquel une commission de performance est due, après déduction de toute commission de performance.

Les commissions de performance sont dues à la Société de Gestion et seront calculées quotidiennement sur la base de la VNI non adaptée (unswing, voir Note 2.w) et les provisions seront ajustées chaque Jour d'évaluation au cours de l'exercice.

En cas de rachat d'actions au cours de l'exercice, la fraction de la commission de performance provisionnée correspondant au montant total du rachat sera définitivement attribuée à la Société de Gestion.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Tableau récapitulatif des compartiments versant une commission de performance

| Compartiment | Catégories | Devise | Taux annuel de commission de performance | « Hurdle rate » | Montant de la commission de performance facturée pour l'exercice (dans la devise du compartiment) | Impact sur la VNI de la classe d'actions de la commission de performance prélevée pour l'exercice (en %) |
|--|--|--------|--|-----------------|---|--|
| Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023) | Action « Classic - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2% | - | 0,00% |
| Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023) | Action « I - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2% | - | 0,00% |
| Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023) | Action « N - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2% | - | 0,00% |
| Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023) | Action « Privilège - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2% | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Classic - Capitalisation » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Classic - Distribution » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | CZK | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Classic RH EUR - Capitalisation » | EUR | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Classic RH SGD - Capitalisation » | SGD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « I - Capitalisation » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « I EUR - Capitalisation » | EUR | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « I Plus - Capitalisation » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « I RH EUR - Capitalisation » | EUR | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « IH JPY - Capitalisation » | JPY | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « N - Capitalisation » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Privilège - Capitalisation » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Privilège - Distribution » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Privilège RH EUR - Capitalisation » | EUR | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « U7 - Capitalisation » | USD | 20% | S/O | - | 0,00% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | Action « Classic SEK - Capitalisation » | SEK | 20% | S/O | - | 0,00% |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Catégories | Devise | Taux annuel de commission de performance | « Hurdle rate » | Montant de la commission de performance facturée pour l'exercice (dans la devise du compartiment) | Impact sur la VNI de la classe d'actions de la commission de performance prélevée pour l'exercice (en %) |
|--|--|--------|--|--|---|--|
| Global Absolute Return Multi-Factor Bond | Action « Classic - Capitalisation » | EUR | 15% | €str or SOFR(1) | - | 0,00% |
| Global Absolute Return Multi-Factor Bond | Action « I - Capitalisation » | EUR | 15% | €str or SOFR(1) | - | 0,00% |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « Classic - Capitalisation » | EUR | 15% | €str, CZEONIA, SARON 1M or SOFR Overnight(2) | 42 514 | 0,16% |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « Classic - Distribution » | EUR | 15% | €str, CZEONIA, SARON 1M or SOFR Overnight(2) | 6 074 | 0,27% |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « Classic RH CZK - Capitalisation » | CZK | 15% | €str, CZEONIA, SARON 1M or SOFR Overnight(2) | - | 0,00% |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « I - Capitalisation » | EUR | 15% | €str, CZEONIA, SARON 1M or SOFR Overnight(2) | 9 148 | 0,24% |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « N - Capitalisation » | EUR | 15% | €str, CZEONIA, SARON 1M or SOFR Overnight(2) | - | 0,00% |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « Privilege - Capitalisation » | EUR | 15% | €str, CZEONIA, SARON 1M or SOFR Overnight(2) | - | 0,00% |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 15% | €str, CZEONIA, SARON 1M or SOFR Overnight(2) | - | 0,00% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « Classic - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | 45 | 0,00% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « Classic - Distribution » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | 4 070 | 0,10% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « I - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | 6 738 | 0,16% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « K - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | 5 655 | 0,07% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « N - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | - | 0,00% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « Privilege - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | - | 0,00% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | - | 0,00% |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | Action « Classic H EUR - Capitalisation » | EUR | 15% | €str + 2%(3) | 36 384 | 0,07% |

(1) 15% avec l'€str + 2% et le SOFR + 2% (« RH USD ») comme hurdle rates.

(2) 15% avec l'€str + 2%, le CZEONIA + 2% (« RH CZK »), le SARON 1M + 2% (« I RH CHF ») et le SOFR Overnight + 2% (« RH USD ») comme hurdle rates.

(3) 15% avec l'€str + 2% comme hurdle rates.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Note 6 - Autres frais

Les frais servent notamment à couvrir les services suivants :

- les services d'administration, d'agent domiciliataire et de comptabilité du fonds
- l'audit
- les services de dépositaire et de garde
- la documentation, comme la préparation, l'impression, la traduction et la distribution du Prospectus, des DIC et des rapports financiers
- les frais de services et de certification ESG
- la licence des indices financiers (le cas échéant)
- les frais juridiques
- l'inscription des actions à la cote d'une bourse (le cas échéant)
- les dépenses de la société de gestion (y compris notamment en matière de lutte contre le blanchiment d'argent/financement du terrorisme, de connaissance du client, de risque et surveillance des activités déléguées)
- les opérations de marketing
- la publication de données sur la performance des fonds
- les frais d'enregistrement, y compris la traduction
- les services associés à la collecte obligatoire, les rapports fiscaux et réglementaires et la publication de données sur la SICAV, ses investissements et ses actionnaires
- les services d'agent de transfert, de registre et de paiement

Ces frais n'incluent pas les honoraires versés aux Administrateurs indépendants et les remboursements de dépenses raisonnables versés à tous les Administrateurs, les frais d'exploitation des actions couvertes, les droits, taxes et frais de transaction associés à l'achat et à la vente d'actifs, les frais de courtage et autres frais de transaction, les intérêts et les frais bancaires.

Note 7 - Taxes

A la date du Prospectus, la Société n'est redevable d'aucun impôt sur le revenu ou les plus-values au Luxembourg. Elle est soumise au Luxembourg à une taxe d'abonnement annuelle représentant 0,05% de la valeur nette d'inventaire. Ce taux est ramené à 0,01% pour :

- a) les compartiments dont l'objet exclusif est le placement collectif dans des instruments du marché monétaire et des dépôts auprès d'établissements de crédit ;
- b) les compartiments dont l'objet exclusif est le placement collectif en dépôts auprès d'établissements de crédit ;
- c) les compartiments, catégories ou classes réservés aux Investisseurs institutionnels, Gestionnaires et OPC.

La taxe d'abonnement ne s'applique pas dans les cas suivants :

- a) la valeur des actifs représentés par des parts ou actions d'autres OPC, pour autant que ces parts ou actions aient déjà été soumises à la taxe d'abonnement ;
- b) les compartiments, catégories et/ou classes d'actions :
 - (i) dont les titres sont réservés aux investisseurs institutionnels, aux gestionnaires ou aux OPC et
 - (ii) dont l'objet exclusif est le placement collectif dans des instruments du marché monétaire et le placement de dépôts auprès d'établissements de crédit, et
 - (iii) dont l'échéance résiduelle pondérée du portefeuille ne dépasse pas 90 jours, et
 - (iv) ayant obtenu la meilleure note possible auprès d'une agence de notation reconnue ;
- c) les compartiments, catégories et/ou classes d'actions réservés :
 - (i) aux institutions de retraite professionnelle ou aux véhicules d'investissement similaires, créés à l'initiative d'un ou plusieurs employeurs au profit de leurs employés, et
 - (ii) aux sociétés regroupant les investissements d'un ou plusieurs employeurs pour offrir un régime de retraite à leurs employés ;
- d) aux compartiments dont le principal objectif est d'investir dans des organismes de microfinance ;
- e) les compartiments, catégories et/ou classes d'actions :
 - (i) dont les titres sont cotés ou négociés sur au moins une bourse ou un autre marché réglementé en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, et
 - (ii) dont l'objet exclusif est de répliquer la performance d'un ou de plusieurs indices.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Lorsqu'elle est due, la taxe d'abonnement est payable trimestriellement sur la base des actifs nets correspondants et calculée à la fin du trimestre auquel elle se rapporte.

La Société peut en outre être soumise à un impôt étranger sur les OPC et/ou à d'autres taxes imposées par les régulateurs dans les pays où le compartiment est autorisé à la distribution.

Régime fiscal indien

Chaque compartiment peut être assujéti à des impôts sur les sociétés dans certains pays dans lesquels il investit. Les plus-values réalisées lors de la cession de titres indiens détenus par un compartiment sont soumises à l'impôt sur les plus-values en Inde, plus-values présentées dans l'« Etat des opérations et des changements des actifs nets » sous la rubrique « Taxes ». Les impôts sont calculés sur la base des plus-values nettes réalisées, et les moins-values nettes réalisées supérieures aux plus-values peuvent, au terme de l'exercice en Inde et dans certaines conditions, être reportées jusqu'à huit ans ultérieurs afin d'être déduites des futures plus-values. A cet égard, les moins-values à court terme (c.-à-d. lorsque les actions sont détenues pendant moins de 12 mois) peuvent être déduites des plus-values à long terme ou à court terme, tandis que les moins-values à long terme ne peuvent être déduites que des plus-values à long terme. Le droit fiscal indien impose une taxe de 15% (+ la surtaxe et les taxes de santé et d'éducation) sur les plus-values nettes réalisées sur la cession de valeurs mobilières indiennes vendues dans un délai d'un an suivant la date de leur achat et une taxe de 10% (+ la surtaxe et les taxes de santé et d'éducation) si les titres indiens sont vendus plus de 12 mois après leur acquisition. Cette taxe de 10% sur les plus-values à long terme réalisées sur les valeurs mobilières indiennes a été introduite à partir du 1 avril 2018.

Le cas échéant, des provisions quotidiennes sont comptabilisées dans les comptes du compartiment India Equity sous le poste « Autres passifs » de l'Etat des actifs nets.

Note 8 - Dividendes

Les dividendes suivants ont été versés au titre des classes d'actions « MD - Distribution » qui versent des dividendes mensuels :

- Dates de paiement

| Mois | Date d'enregistrement ⁽¹⁾ | Date de VNI ex-dividende ⁽²⁾ | Date de paiement ⁽³⁾ |
|-----------|--------------------------------------|---|---------------------------------|
| Décembre | 30 | 2 janvier 2023 | 5 janvier 2023 |
| Janvier | 31 | 1 février 2023 | 6 février 2023 |
| Février | 28 | 1 mars 2023 | 6 mars 2023 |
| Mars | 31 | 3 avril 2023 | 6 avril 2023 |
| Avril | 28 | 2 mai 2023 | 5 mai 2023 |
| Mai | 31 | 1 juin 2023 | 6 juin 2023 |
| Juin | 30 | 3 juillet 2023 | 6 juillet 2023 |
| Juillet | 31 | 1 août 2023 | 4 août 2023 |
| Août | 31 | 1 septembre 2023 | 6 septembre 2023 |
| Septembre | 29 | 2 octobre 2023 | 5 octobre 2023 |
| Octobre | 31 | 2 novembre 2023 | 7 novembre 2023 |
| Novembre | 30 | 1 décembre 2023 | 6 décembre 2023 |

⁽¹⁾ Si, pour une quelconque raison, la valorisation n'est pas possible le jour en question, la date d'enregistrement est reportée à la date d'évaluation précédente.

⁽²⁾ Les dates sont basées sur une simulation de valorisation. Par conséquent, elles peuvent varier en fonction de la composition du portefeuille à cette date. Si, pour une quelconque raison, la valorisation n'est pas possible le jour en question, la date ex-dividende est reportée au jour de valorisation suivant au cours duquel la valorisation est possible et la date de paiement est reportée au troisième jour ouvrable bancaire au Luxembourg suivant la nouvelle date ex-dividende. Si, pour une quelconque raison, le règlement ne peut intervenir à la nouvelle date de paiement (p. ex. jour férié bancaire concernant une devise ou un pays spécifique), il sera effectué le premier jour ouvrable suivant ou tout autre jour que l'agent local indiquera.

⁽³⁾ Si ce jour n'est pas un jour ouvrable bancaire au Luxembourg, la date de paiement sera le jour ouvrable bancaire suivant. Si le règlement ne peut intervenir pour une raison donnée (p. ex. jour férié bancaire concernant une devise ou un pays spécifique), il sera effectué le premier jour ouvrable suivant ou tout autre jour que l'agent local indiquera.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Les dividendes suivants ont été versés au titre de la classe d'actions « XH AUD QD - Distribution », qui verse des dividendes trimestriels :

- Dates de paiement

| Mois | Date d'enregistrement ⁽¹⁾ | Date de VNI ex-dividende ⁽²⁾ | Date de paiement ⁽³⁾ |
|-----------|--------------------------------------|---|---------------------------------|
| Décembre | 30 | 2 janvier 2023 | 5 janvier 2023 |
| Mars | 31 | 3 avril 2023 | 6 avril 2023 |
| Juin | 30 | 3 juillet 2023 | 6 juillet 2023 |
| Septembre | 29 | 2 octobre 2023 | 5 octobre 2023 |

⁽¹⁾ Si, pour une quelconque raison, la valorisation n'est pas possible le jour en question, la date d'enregistrement est reportée à la date d'évaluation précédente.

⁽²⁾ Les dates sont basées sur une simulation de valorisation. Par conséquent, elles peuvent varier en fonction de la composition du portefeuille à cette date. Si, pour une quelconque raison, la valorisation n'est pas possible le jour en question, la date ex-dividende est reportée au jour de valorisation suivant au cours duquel la valorisation est possible et la date de paiement est reportée au troisième jour ouvrable bancaire au Luxembourg suivant la nouvelle date ex-dividende. Si, pour une quelconque raison, le règlement ne peut intervenir à la nouvelle date de paiement (p. ex. jour férié bancaire concernant une devise ou un pays spécifique), il sera effectué le premier jour ouvrable suivant ou tout autre jour que l'agent local indiquera.

⁽³⁾ Si ce jour n'est pas un jour ouvrable bancaire au Luxembourg, la date de paiement sera le jour ouvrable bancaire suivant. Si le règlement ne peut intervenir pour une raison donnée (p. ex. jour férié bancaire concernant une devise ou un pays spécifique), il sera effectué le premier jour ouvrable suivant ou tout autre jour que l'agent local indiquera.

Les dividendes annuels ont été versés le 2 mai 2023 au titre des actions en circulation le 18 avril 2023, avec une date ex-dividende au 19 avril 2023.

- Montants mensuels, trimestriels et annuels :

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|----------------------|---|--------|----------------------|--|
| Aqua | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,83 | 4 688 828 |
| Aqua | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 1,67(7) | 107 |
| Aqua | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 2,92(10) | 232 |
| Aqua | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,35(1) | 4 |
| Aqua | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,39(2) | 30 |
| Aqua | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,25(3) | 15 |
| Aqua | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,55(1) | 19 068 |
| Aqua | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,40(4) | 164 604 |
| Aqua | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,54(1) | 108 813 |
| Aqua | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,60(4) | 1 291 488 |
| Aqua | Action « Classic USD - Distribution » | USD | 2,56 | 32 042 |
| Aqua | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 2,89 | 803 738 |
| Asia High Yield Bond | Action « I - Distribution » | USD | 11,74 | 8 218 000 |
| Belgium Equity | Action « Classic - Distribution » | EUR | 13,76 | 1 191 011 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|-----------------------|---|--------|----------------------|--|
| Brazil Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 3,54 | 172 649 |
| China A-Shares | Action « Classic - Distribution » | USD | 1,89 | 1 365 |
| China Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 5,08 | 185 742 |
| China Equity | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 2,66 | 439 800 |
| China Equity | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,11(1) | 14 |
| China Equity | Action « Privilege - Distribution » | USD | 2,44 | 3 924 |
| Climate Impact | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,87 | 1 747 204 |
| Climate Impact | Action « I - Distribution » | EUR | 1,73 | 14 985 |
| Climate Impact | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,10 | 590 115 |
| Climate Impact | Action « Privilege RH CHF - Distribution » | CHF | 2,09 | 212 |
| Climate Impact | Action « Privilege RH EUR - Distribution » | EUR | 1,62 | 6 623 |
| Climate Impact | Action « Privilege RH GBP - Distribution » | GBP | 1,63 | 174 400 |
| Climate Impact | Action « Privilege USD - Distribution » | USD | 1,68 | 194 494 |
| Climate Impact | Action « U2 HKD - Distribution » | HKD | 1,79 | 19 835 |
| Climate Impact | Action « U2 HKD MD - Distribution » | HKD | 0,25 | 429 |
| Climate Impact | Action « U2 RH AUD - Distribution » | AUD | 1,64 | 17 936 |
| Climate Impact | Action « U2 RH CHF - Distribution » | CHF | 1,54 | 3 128 |
| Climate Impact | Action « U2 RH CNH - Distribution » | CNH | 1,73 | 774 |
| Climate Impact | Action « U2 RH CNH MD - Distribution » | CNH | 5,00(1) | 68 |
| Climate Impact | Action « U2 RH CNH MD - Distribution » | CNH | 1,42(4) | 203 |
| Climate Impact | Action « U2 RH EUR - Distribution » | EUR | 2,09 | 209 |
| Climate Impact | Action « U2 RH EUR MD - Distribution » | EUR | 0,21(1) | 21 |
| Climate Impact | Action « U2 RH EUR MD - Distribution » | EUR | 0,09(4) | 543 |
| Climate Impact | Action « U2 RH GBP - Distribution » | GBP | 1,68 | 15 787 |
| Climate Impact | Action « U2 RH SGD - Distribution » | SGD | 2,11 | 144 |
| Climate Impact | Action « U2 RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,25(1) | 121 |
| Climate Impact | Action « U2 RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,14(4) | 3 160 |
| Climate Impact | Action « U2 USD - Distribution » | USD | 1,68 | 22 632 |
| Climate Impact | Action « U2 USD MD - Distribution » | USD | 0,25 | 74 |
| Consumer Innovators | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,35 | 718 742 |
| Consumer Innovators | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 2,93 | 111 344 |
| Disruptive Technology | Action « Classic - Distribution » | EUR | 24,63 | 2 638 844 |
| Disruptive Technology | Action « Classic USD - Distribution » | USD | 8,15 | 171 422 |
| Disruptive Technology | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 8,04 | 564 469 |
| Disruptive Technology | Action « UP4 - Distribution » | EUR | 2,72 | 1 227 874 |
| Ecosystem Restoration | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,04 | 60 879 |
| Ecosystem Restoration | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 1,05 | 11 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|-----------------------------|---|--------|----------------------|--|
| Emerging Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,85(1) | 210 |
| Emerging Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,56(4) | 19 423 |
| Emerging Bond | Action « BH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,85(1) | 348 |
| Emerging Bond | Action « BH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,52(4) | 2 280 |
| Emerging Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 3,97 | 387 342 |
| Emerging Bond | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 15,09 | 187 225 |
| Emerging Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,62(1) | 11 132 |
| Emerging Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,38(4) | 42 547 |
| Emerging Bond | Action « Classic H EUR - Distribution » | EUR | 4,23 | 380 939 |
| Emerging Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,75(1) | 172 955 |
| Emerging Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,50(4) | 2 203 689 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,83(1) | 659 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,52(4) | 5 412 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « B RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,83(1) | 57 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « B RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,48(4) | 351 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « B RH ZAR MD - Distribution » | ZAR | 11,71(1) | 216 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « B RH ZAR MD - Distribution » | ZAR | 6,73(4) | 873 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic - Distribution » | USD | 7,03 | 138 649 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 6,06 | 9 326 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic EUR MD - Distribution » | EUR | 0,67(1) | 10 780 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic EUR MD - Distribution » | EUR | 0,51(4) | 107 932 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic HKD MD - Distribution » | HKD | 0,64(1) | 20 348 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic HKD MD - Distribution » | HKD | 0,41(4) | 151 947 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,14(1) | 1 528 955 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,09(4) | 11 470 167 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic MD2 - Distribution » | USD | 0,58(1) | 6 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic MD2 - Distribution » | USD | 0,60(4) | 66 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,63(1) | 21 262 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,37(4) | 142 415 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 7,97(1) | 1 081 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 3,33(4) | 4 853 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH EUR - Distribution » | EUR | 0,96 | 178 106 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,64(1) | 25 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,41(4) | 187 923 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|---|---|--------|----------------------|--|
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,63(1) | 1 039 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,35(4) | 5 919 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH ZAR MD - Distribution » | ZAR | 8,53(1) | 16 529 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Classic RH ZAR MD - Distribution » | ZAR | 4,95(4) | 100 098 |
| Emerging Bond Opportunities | Action « Privilège RH EUR - Distribution » | EUR | 3,23 | 499 083 |
| Emerging Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 3,20 | 484 157 |
| Emerging Equity | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 2,37 | 141 558 |
| Emerging Markets Climate Solutions | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,61 | 26 |
| Emerging Markets Climate Solutions | Action « Privilège - Distribution » | USD | 2,62 | 26 |
| Energy Transition | Action « Classic - Distribution » | EUR | 8,09 | 1 673 765 |
| Energy Transition | Action « Classic USD - Distribution » | USD | 8,61 | 229 256 |
| Energy Transition | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 2,11 | 725 507 |
| Enhanced Bond 6M | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,15 | 125 777 |
| Enhanced Bond 6M | Action « I - Distribution » | EUR | 2,12 | 424 424 |
| Enhanced Bond 6M | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 2,17 | 264 856 |
| Euro Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,28 | 1 272 863 |
| Euro Bond | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 3,29 | 337 928 |
| Euro Bond Opportunities | Action « Classic - Distribution » | EUR | 0,75 | 1 229 221 |
| Euro Corporate Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 4,25 | 2 234 612 |
| Euro Corporate Bond | Action « I - Distribution » | EUR | 3,98 | 183 317 |
| Euro Corporate Bond | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 4,27 | 2 308 751 |
| Euro Corporate Bond | Action « X - Distribution » | EUR | 7,64 | 8 915 681 |
| Euro Corporate Bond Opportunities | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,86 | 346 663 |
| Euro Defensive Equity | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,51 | 8 988 |
| Euro Defensive Equity | Action « I - Distribution » | EUR | 3,19 | 613 332 |
| Euro Equity | Action « Classic - Distribution » | EUR | 9,44 | 2 228 988 |
| Euro Equity | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 4,40 | 96 355 |
| Euro Government Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,17 | 303 595 |
| Euro Government Bond | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 3,25 | 154 105 |
| Euro High Quality Government Bond (liquidated on 23 May 2023) | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,50(9) | 197 297 |
| Euro High Yield Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 6,13 | 4 382 008 |
| Euro High Yield Bond | Action « Classic H USD MD - Distribution » | USD | 0,41(1) | 288 |
| Euro High Yield Bond | Action « Classic H USD MD - Distribution » | USD | 0,72(4) | 3 694 |
| Euro High Yield Bond | Action « Classic MD - Distribution » | EUR | 0,34(1) | 3 451 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|--|---|--------|----------------------|--|
| Euro High Yield Bond | Action « Classic MD - Distribution » | EUR | 0,52(4) | 57 505 |
| Euro High Yield Bond | Action « I - Distribution » | EUR | 6,36 | 580 161 |
| Euro High Yield Bond | Action « N - Distribution » | EUR | 7,38 | 226 341 |
| Euro High Yield Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 6,43 | 166 005 |
| Euro High Yield Short Duration Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 5,81 | 454 396 |
| Euro High Yield Short Duration Bond | Action « Classic H USD - Distribution » | USD | 6,17 | 106 704 |
| Euro High Yield Short Duration Bond | Action « N - Distribution » | EUR | 5,73 | 75 107 |
| Euro Inflation-Linked Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,78 | 367 007 |
| Euro Inflation-Linked Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,67 | 57 468 |
| Euro Medium Term Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,32 | 801 367 |
| Euro Medium Term Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,37 | 404 662 |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,82 | 708 444 |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,70 | 17 304 |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | Action « X - Distribution » | EUR | 3,79 | 265 236 |
| Europe Convertible | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,33 | 220 941 |
| Europe Convertible | Action « N - Distribution » | EUR | 3,31 | 36 050 |
| Europe Convertible | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 2,80 | 13 401 |
| Europe Equity | Action « Classic - Distribution » | EUR | 4,62 | 1 982 932 |
| Europe Equity | Action « Classic CHF - Distribution » | CHF | 3,56 | 4 663 |
| Europe Equity | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,70 | 1 390 991 |
| Europe Growth | Action « Classic - Distribution » | EUR | 4,74 | 244 668 |
| Europe Growth | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,28(1) | 981 |
| Europe Growth | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,29(4) | 8 697 |
| Europe Growth | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,25(1) | 1 834 |
| Europe Growth | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,42(4) | 32 039 |
| Europe Growth | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 4,28 | 1 817 380 |
| Europe High Conviction Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,62 | 24 704 |
| Europe High Conviction Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,63 | 6 958 |
| Europe Real Estate Securities | Action « Classic - Distribution » | EUR | 5,21 | 954 841 |
| Europe Real Estate Securities | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 5,28 | 276 029 |
| Europe Real Estate Securities | Action « X - Distribution » | EUR | 3,33 | 327 396 |
| Europe Small Cap | Action « Classic - Distribution » | EUR | 5,54 | 1 593 671 |
| Europe Small Cap | Action « I - Distribution » | EUR | 2,75 | 399 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|------------------------------|---|--------|----------------------|--|
| Europe Small Cap | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 5,35 | 153 159 |
| Europe Small Cap Convertible | Action « Classic - Distribution » | EUR | 5,13 | 1 559 783 |
| Europe Small Cap Convertible | Action « I - Distribution » | EUR | 4,03 | 1 209 |
| Europe Small Cap Convertible | Action « N - Distribution » | EUR | 5,94 | 320 745 |
| Europe Small Cap Convertible | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 5,29 | 230 612 |
| Flexible Global Credit | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,95 | 9 750 |
| Flexible Global Credit | Action « X - Distribution » | EUR | 2,07 | 367 663 |
| Global Bond Opportunities | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,86 | 3 100 798 |
| Global Bond Opportunities | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 1,93 | 84 998 |
| Global Convertible | Action « Classic - Distribution » | USD | 4,87 | 155 226 |
| Global Convertible | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,06(1) | 948 |
| Global Convertible | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,05(4) | 7 707 |
| Global Convertible | Action « Classic RH EUR - Distribution » | EUR | 3,71 | 3 191 973 |
| Global Convertible | Action « Classic RH PLN - Distribution » | PLN | 21,97 | 1 687 |
| Global Convertible | Action « N RH EUR - Distribution » | EUR | 4,23 | 54 927 |
| Global Convertible | Action « Privilège RH EUR - Distribution » | EUR | 4,92 | 290 225 |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,88 | 8 776 |
| Global Enhanced Bond 36M | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 1,89 | 10 747 |
| Global Environment | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,86 | 2 475 175 |
| Global Environment | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 1,67(7) | 819 |
| Global Environment | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 2,92(10) | 1 916 |
| Global Environment | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,35(1) | 4 |
| Global Environment | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,39(2) | 30 |
| Global Environment | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,25(3) | 15 |
| Global Environment | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,55(1) | 68 066 |
| Global Environment | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,38(4) | 493 710 |
| Global Environment | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,52(1) | 119 665 |
| Global Environment | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,55(4) | 1 213 989 |
| Global Environment | Action « N - Distribution » | EUR | 2,48 | 27 377 |
| Global Environment | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 2,61 | 138 499 |
| Global Environment | Action « Privilège GBP - Distribution » | GBP | 2,62 | 878 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|------------------------------|---|--------|----------------------|--|
| Global Environment | Action « X - Distribution » | EUR | 1 998,03 | 272 553 |
| Global High Yield Bond | Action « BH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,72(1) | 537 |
| Global High Yield Bond | Action « BH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,50(4) | 3 688 |
| Global High Yield Bond | Action « BH USD MD - Distribution » | USD | 0,71(1) | 6 372 |
| Global High Yield Bond | Action « BH USD MD - Distribution » | USD | 0,55(4) | 34 939 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,28 | 401 308 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,54(1) | 16 596 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,37(4) | 108 009 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic H USD - Distribution » | USD | 1,87 | 24 764 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic H USD MD - Distribution » | USD | 0,54(1) | 35 554 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic H USD MD - Distribution » | USD | 0,43(4) | 290 686 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic USD MD - Distribution » | USD | 0,42(1) | 98 716 |
| Global High Yield Bond | Action « Classic USD MD - Distribution » | USD | 0,22(4) | 511 650 |
| Global High Yield Bond | Action « N - Distribution » | EUR | 3,87 | 35 522 |
| Global High Yield Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 4,18 | 514 829 |
| Global Inflation-Linked Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,10 | 179 648 |
| Global Inflation-Linked Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 1,70 | 3 866 |
| Green Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,56 | 726 853 |
| Green Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 2,60 | 1 318 772 |
| Green Bond | Action « X - Distribution » | EUR | 2 689,87 | 16 144 374 |
| Green Bond | Action « XH AUD QD - Distribution » | AUD | 259,38(1) | 15 208 |
| Green Bond | Action « XH AUD QD - Distribution » | AUD | 766,86(5) | 133 559 |
| Green Tigers | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,92 | 41 870 |
| Green Tigers | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 5,08 | 1 018 151 |
| Green Tigers | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,20 | 22 |
| Green Tigers | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,37(1) | 416 |
| Green Tigers | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,05(4) | 1 295 |
| Green Tigers | Action « Privilege - Distribution » | USD | 2,06 | 944 128 |
| Green Tigers | Action « Privilege EUR - Distribution » | EUR | 4,13 | 600 366 |
| Green Tigers | Action « Privilege RH EUR - Distribution » | EUR | 2,04 | 21 669 |
| Green Tigers | Action « U2 - Distribution » | USD | 2,14 | 8 453 |
| Green Tigers | Action « U2 RH GBP - Distribution » | GBP | 2,05 | 15 314 |
| Health Care Innovators | Action « Classic - Distribution » | EUR | 16,21 | 1 941 356 |
| Health Care Innovators | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,88 | 31 441 |
| Inclusive Growth | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,52 | 150 623 |
| Inclusive Growth | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 1,97 | 73 008 |
| India Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 1,63 | 70 225 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|--|---|--------|----------------------|--|
| India Equity | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 1,53 | 47 160 |
| Japan Equity | Action « Classic - Distribution » | JPY | 100,93 | 16 213 579 |
| Japan Equity | Action « Privilège - Distribution » | JPY | 415,94 | 2 488 882 |
| Japan Small Cap | Action « Classic - Distribution » | JPY | 219,07 | 9 826 867 |
| Latin America Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 18,68 | 222 348 |
| Local Emerging Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,82(1) | 8 |
| Local Emerging Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,57(4) | 5 178 |
| Local Emerging Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,93 | 1 045 903 |
| Local Emerging Bond | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 3,22 | 1 340 035 |
| Local Emerging Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,32(1) | 160 267 |
| Local Emerging Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,23(4) | 952 917 |
| Local Emerging Bond | Action « Classic RH EUR - Distribution » | EUR | 2,16 | 57 040 |
| Local Emerging Bond | Action « Privilège - Distribution » | USD | 2,82 | 16 860 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,62(1) | 6 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,25(4) | 33 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « B RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,62(1) | 42 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « B RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,21(4) | 153 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,91 | 1 771 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 3,10 | 42 041 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic HKD MD - Distribution » | HKD | 0,51(1) | 1 475 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic HKD MD - Distribution » | HKD | 0,21(4) | 6 657 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,51(1) | 26 233 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,20(4) | 89 149 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,50(1) | 4 345 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,17(4) | 14 993 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 0,72(1) | 55 618 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 0,14(4) | 74 822 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|--|---|--------|----------------------|--|
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic RH EUR - Distribution » | EUR | 2,27 | 1 366 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,52(1) | 5 931 |
| Multi-Asset Opportunities (formerly Emerging Multi-Asset Income) | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,15(4) | 18 006 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,67 | 116 071 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic MD - Distribution » | EUR | 0,10(1) | 43 587 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic MD - Distribution » | EUR | 0,13(4) | 539 146 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,16(1) | 6 735 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,23(4) | 86 209 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | CAD | 0,14(1) | 1 115 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | CAD | 0,20(4) | 11 553 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 0,39(1) | 65 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 2,12(2) | 1 947 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 0,96(3) | 678 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,16(1) | 1 509 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,28(2) | 15 216 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,17(3) | 7 204 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,16(1) | 4 056 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,18(4) | 40 568 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,14(1) | 16 385 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,28(4) | 286 400 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Privilege RH USD MD - Distribution » | USD | 0,14(1) | 48 |
| Multi-Asset Thematic | Action « Privilege RH USD MD - Distribution » | USD | 0,29(4) | 1 086 |
| Nordic Small Cap | Action « Classic - Distribution » | EUR | 10,85 | 504 533 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|----------------------------------|---|--------|----------------------|--|
| Nordic Small Cap | Action « Classic H NOK - Distribution » | NOK | 40,89 | 1 215 023 |
| RMB Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,65 | 39 873 |
| RMB Bond | Action « Classic CNH MD - Distribution » | CNH | 3,33(1) | 5 |
| RMB Bond | Action « Classic CNH MD - Distribution » | CNH | 3,36(4) | 55 |
| RMB Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,33(1) | 67 |
| RMB Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,39(4) | 855 |
| RMB Bond | Action « Classic H EUR MD - Distribution » | EUR | 0,29(1) | 92 |
| RMB Bond | Action « Classic H EUR MD - Distribution » | EUR | 0,27(2) | 526 |
| RMB Bond | Action « Classic H EUR MD - Distribution » | EUR | 0,39(3) | 628 |
| RMB Bond | Action « Classic H HKD MD - Distribution » | HKD | 0,33(1) | 13 |
| RMB Bond | Action « Classic H HKD MD - Distribution » | HKD | 0,46(4) | 198 |
| RMB Bond | Action « Classic H SGD MD - Distribution » | SGD | 0,33 | 885 |
| RMB Bond | Action « Classic H USD MD - Distribution » | USD | 0,33(1) | 9 151 |
| RMB Bond | Action « Classic H USD MD - Distribution » | USD | 0,46(4) | 131 384 |
| RMB Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,33(1) | 3 |
| RMB Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,31(4) | 33 |
| RMB Bond | Action « Privilege - Distribution » | USD | 2,72 | 7 211 |
| SMaRT Food | Action « Classic - Distribution » | EUR | 2,37 | 574 058 |
| SMaRT Food | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,29(1) | 3 091 |
| SMaRT Food | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,39(4) | 52 822 |
| SMaRT Food | Action « I MD - Distribution » | EUR | 0,33(8) | 106 994 |
| SMaRT Food | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 2,60 | 207 719 |
| SMaRT Food | Action « U - Distribution » | EUR | 2,31 | 39 430 |
| SMaRT Food | Action « U RH CHF - Distribution » | CHF | 2,29 | 10 475 |
| SMaRT Food | Action « U RH GBP - Distribution » | GBP | 2,35 | 267 |
| SMaRT Food | Action « U RH USD - Distribution » | USD | 2,41 | 1 186 |
| SMaRT Food | Action « UP - Distribution » | EUR | 2,37 | 103 037 |
| SMaRT Food | Action « UP RH CHF - Distribution » | CHF | 2,36 | 110 302 |
| SMaRT Food | Action « UP RH GBP - Distribution » | GBP | 2,40 | 106 740 |
| SMaRT Food | Action « UP RH USD - Distribution » | USD | 2,45 | 48 298 |
| Social Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,72 | 17 |
| Social Bond | Action « I - Distribution » | EUR | 1,73 | 220 774 |
| Social Bond | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 1,73 | 17 |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 10,79 | 97 437 |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 10,14 | 1 370 017 |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,11 | 1 653 |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | Action « N RH EUR - Distribution » | EUR | 2,89 | 27 660 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|--|--|--------|----------------------|--|
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | Action « Privilège EUR - Distribution » | EUR | 3,47 | 211 653 |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | Action « Privilège Plus EUR - Distribution » | EUR | 1,47 | 765 688 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 6,36 | 152 293 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 5,91 | 243 034 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,29(1) | 22 899 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,39(4) | 483 590 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,28(1) | 1 301 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,34(4) | 53 046 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 5,42(4) | 26 818 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,67(4) | 7 889 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,29(1) | 1 308 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,31(4) | 20 938 |
| Sustainable Asian Cities Bond | Action « Privilège - Distribution » | USD | 5,53 | 26 294 |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,87 | 537 909 |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | Action « I - Distribution » | EUR | 2,14 | 450 705 |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 1,90 | 869 478 |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | Action « X - Distribution » | EUR | 21,29 | 22 566 485 |
| Sustainable Euro Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,25 | 211 105 |
| Sustainable Euro Bond | Action « IH GBP - Distribution » | GBP | 2,91 | 110 567 |
| Sustainable Euro Bond | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 3,20 | 48 870 |
| Sustainable Euro Bond | Action « Privilège H GBP - Distribution » | GBP | 2,89 | 328 |
| Sustainable Euro Corporate Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,98 | 1 529 913 |
| Sustainable Euro Corporate Bond | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 3,88 | 681 097 |
| Sustainable Euro Corporate Bond | Action « X - Distribution » | EUR | 3,74 | 9 276 928 |
| Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,74 | 93 569 |
| Sustainable Europe Dividend | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,37 | 141 611 |
| Sustainable Europe Dividend | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,23(1) | 1 948 |
| Sustainable Europe Dividend | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,38(4) | 34 993 |
| Sustainable Europe Dividend | Action « N - Distribution » | EUR | 2,86 | 4 168 |
| Sustainable Europe Dividend | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 3,52 | 648 755 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|--|---|--------|----------------------|--|
| Sustainable Europe Multi-Factor Equity | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,28 | 108 188 |
| Sustainable Europe Multi-Factor Equity | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,31 | 6 031 |
| Sustainable Europe Value | Action « Classic - Distribution » | EUR | 4,14 | 146 501 |
| Sustainable Europe Value | Action « I MD - Distribution » | EUR | 0,33(8) | 51 971 |
| Sustainable Europe Value | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 4,32 | 1 770 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,37(1) | 52 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,44(6) | 2 421 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,59(7) | 56 676 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 6,17 | 243 607 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic H CNH MD - Distribution » | CNH | 6,25(1) | 271 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic H CNH MD - Distribution » | CNH | 4,18(6) | 907 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic H CNH MD - Distribution » | CNH | 5,79(7) | 1 438 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic HKD MD - Distribution » | HKD | 0,38(1) | 0 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic HKD MD - Distribution » | HKD | 0,54(6) | 5 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic HKD MD - Distribution » | HKD | 0,71(7) | 6 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,37(1) | 1 046 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,46(6) | 8 715 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,61(7) | 113 323 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « NH EUR - Distribution » | EUR | 4,90 | 44 957 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « Privilege - Distribution » | USD | 5,78 | 332 562 |
| Sustainable Global Corporate Bond | Action « X - Distribution » | USD | 5,64 | 6 444 376 |
| Sustainable Global Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,12 | 546 740 |
| Sustainable Global Equity | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 2,91 | 374 783 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « B USD MD - Distribution » | USD | 0,13(1) | 1 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « B USD MD - Distribution » | USD | 0,24(4) | 22 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,88 | 616 638 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 2,08(7) | 133 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic RH CNH MD - Distribution » | CNH | 3,33(10) | 264 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,19(1) | 2 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,45(2) | 30 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,31(3) | 20 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,17(1) | 16 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|---|---|--------|----------------------|--|
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,45(4) | 458 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic USD - Distribution » | USD | 8,06 | 14 747 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic USD MD - Distribution » | USD | 0,17(1) | 962 |
| Sustainable Global Low Vol Equity | Action « Classic USD MD - Distribution » | USD | 0,31(4) | 17 544 |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 4,97 | 50 |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | Action « Privilege - Distribution » | USD | 5,00 | 50 |
| Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond | Action « Privilege - Distribution » | USD | 9,74 | 1 174 726 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,28 | 1 060 146 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic MD - Distribution » | EUR | 0,29(1) | 26 427 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic MD - Distribution » | EUR | 0,20(4) | 176 508 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,39(1) | 150 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,31(4) | 1 259 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | CAD | 0,36(1) | 149 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | CAD | 0,27(4) | 1 222 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,38(1) | 27 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,36(2) | 152 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,23(3) | 82 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,38(1) | 161 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,25(4) | 1 153 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH USD - Distribution » | USD | 3,03 | 131 544 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,38(1) | 1 996 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,39(4) | 22 229 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Classic Solidarity BE - Distribution » | EUR | 2,76 | 4 029 861 |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 3,19 | 2 533 695 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic - Distribution » | EUR | 3,45 | 112 542 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|--|---|--------|----------------------|--|
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,40(1) | 26 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,30(4) | 202 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | CAD | 0,38(1) | 26 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH CAD MD - Distribution » | CAD | 0,26(4) | 197 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,40(1) | 5 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,35(2) | 24 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH HKD MD - Distribution » | HKD | 0,22(3) | 15 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,45(1) | 225 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH SGD MD - Distribution » | SGD | 0,25(4) | 1 367 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,47(1) | 72 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,41(4) | 685 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Classic Solidarity BE - Distribution » | EUR | 2,69 | 1 567 301 |
| Sustainable Multi-Asset Growth | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 2,91 | 300 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Action « Classic - Distribution » | EUR | 6,57 | 2 142 080 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Action « Classic Solidarity BE - Distribution » | EUR | 2,95 | 2 841 507 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Action « Privilege - Distribution » | EUR | 2,88 | 40 582 |
| Sustainable Multi-Asset Stability | Action « Privilege Solidarity BE - Distribution » | EUR | 2,91 | 1 466 |
| Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | Action « Privilege - Distribution » | USD | 5,42 | 2 716 439 |
| Sustainable US Multi-Factor Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,07 | 226 891 |
| Sustainable US Multi-Factor Equity | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 1,95 | 106 493 |
| Sustainable US Multi-Factor Equity | Action « Privilege - Distribution » | USD | 1,97 | 137 656 |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | Action « Classic - Distribution » | USD | 3,04 | 84 220 |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | Action « Classic H EUR - Distribution » | EUR | 2,64 | 30 998 |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | Action « N - Distribution » | USD | 2,79 | 69 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Classe | Devise | Dividende par action | Montant total dans la devise du compartiment |
|--|---|--------|----------------------|--|
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | Action « Privilège H EUR - Distribution » | EUR | 2,82 | 106 819 |
| Target Risk Balanced | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,48(1) | 859 |
| Target Risk Balanced | Action « Classic RH USD MD - Distribution » | USD | 0,21(4) | 3 452 |
| Turkey Equity | Action « Classic - Distribution » | EUR | 1,93 | 36 134 |
| Turkey Equity | Action « Privilège - Distribution » | EUR | 1,10 | 5 872 |
| US Growth | Action « Classic - Distribution » | USD | 0,62 | 200 393 |
| US Growth | Action « Classic H EUR - Distribution » | EUR | 2,08 | 13 344 |
| US Growth | Action « Privilège - Distribution » | USD | 1,43 | 11 416 |
| US Growth | Action « Privilège H EUR - Distribution » | EUR | 1,25 | 2 081 |
| US High Yield Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,46(1) | 5 |
| US High Yield Bond | Action « B MD - Distribution » | USD | 0,60(4) | 66 |
| US High Yield Bond | Action « BH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,46(1) | 31 |
| US High Yield Bond | Action « BH AUD MD - Distribution » | AUD | 0,54(4) | 395 |
| US High Yield Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 6,77 | 68 050 |
| US High Yield Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,35(1) | 5 894 |
| US High Yield Bond | Action « Classic H AUD MD - Distribution » | AUD | 0,43(4) | 73 857 |
| US High Yield Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,29(1) | 125 362 |
| US High Yield Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,39(4) | 1 742 559 |
| US Mid Cap | Action « Classic - Distribution » | USD | 3,23 | 68 253 |
| US Small Cap | Action « Classic - Distribution » | USD | 2,77 | 102 874 |
| US Small Cap | Action « Classic EUR - Distribution » | EUR | 2,60 | 40 393 |
| US Small Cap | Action « Privilège - Distribution » | USD | 2,41 | 104 214 |
| USD Money Market | Action « Classic - Distribution » | USD | 1,83 | 323 286 |
| USD Short Duration Bond | Action « Classic - Distribution » | USD | 4,25 | 426 504 |
| USD Short Duration Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,07(1) | 4 526 |
| USD Short Duration Bond | Action « Classic MD - Distribution » | USD | 0,54(4) | 1 421 016 |
| USD Short Duration Bond | Action « Privilège - Distribution » | USD | 4,42 | 61 946 |

(1) En janvier 2023

(2) De février à juillet 2023

(3) D'août à décembre 2023

(4) De février à décembre 2023

(5) En avril, juillet et octobre 2023

(6) De février à juin 2023

(7) De juillet à décembre 2023

(8) A partir de juin 2023

(9) Jusqu'à la liquidation en mai 2023

(10) De janvier à juin 2023

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Note 9 - Devises des actions

La valeur nette d'inventaire par action est évaluée dans la devise de la classe d'actions et non dans celle du compartiment à la section « Chiffres clés concernant les 3 derniers exercices ».

Note 10 - Taux de change

Les taux de change suivants ont été utilisés pour la consolidation et la conversion des classes d'actions libellées dans une devise différente de la devise de référence du compartiment concerné au 31 décembre 2023 :

| | |
|---------|---------------|
| EUR 1 = | AUD 1,61890 |
| EUR 1 = | BRL 5,36595 |
| EUR 1 = | CAD 1,45660 |
| EUR 1 = | CHF 0,92970 |
| EUR 1 = | CNH 7,86580 |
| EUR 1 = | CZK 24,68850 |
| EUR 1 = | GBP 0,86655 |
| EUR 1 = | HKD 8,62575 |
| EUR 1 = | HUF 382,2150 |
| EUR 1 = | JPY 155,73355 |
| EUR 1 = | NOK 11,21850 |
| EUR 1 = | PLN 4,34375 |
| EUR 1 = | SEK 11,13250 |
| EUR 1 = | SGD 1,45715 |
| EUR 1 = | USD 1,10465 |
| EUR 1 = | ZAR 20,20130 |

Note 11 - Contrats futures

Au 31 décembre 2023, les positions suivantes étaient ouvertes :

Emerging Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 34 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 5 153 723 | (134 082) |
| EUR | 3 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 469 653 | (31 880) |
| EUR | 18 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 2 371 728 | (33 405) |
| USD | 62 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 7 316 969 | (356 500) |
| USD | 95 | A | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 12 691 406 | 858 601 |
| USD | 92 | A | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 10 385 938 | 273 671 |
| | | | | | Total : | 576 405 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 359 747.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Emerging Bond Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 4 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 626 204 | (42 507) |
| EUR | 17 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 2 239 965 | (31 549) |
| EUR | 8 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 1 212 641 | (31 549) |
| USD | 33 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 3 894 516 | (189 750) |
| USD | 25 | A | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 3 339 844 | 208 656 |
| USD | 219 | A | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 24 723 047 | 828 633 |
| USD | 99 | A | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 10 768 570 | 252 141 |
| | | | | | Total : | 994 075 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD (107 891).

Multi-Asset Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 9 | A | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 1 307 453 | 37 780 |
| EUR | 2 | V | EURO STOXX 50 - FUTURE | 15/03/2024 | 100 369 | 806 |
| USD | 3 | A | MSCI DAILY TR NET BRAZIL USD | 15/03/2024 | 192 048 | 13 524 |
| USD | 2 | V | S&P 500 E-MINI FUTURE | 15/03/2024 | 482 000 | (15 975) |
| USD | 6 | V | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 677 344 | (17 062) |
| GBP | 9 | A | FTSE 100 INDEX | 15/03/2024 | 889 896 | 25 699 |
| JPY | 4 | A | TOPIX INDX FUTURE | 07/03/2024 | 671 301 | 4 511 |
| JPY | 12 | V | 10 YR MINI JGB FUTURE (SGX) | 12/03/2024 | 1 247 241 | (8 980) |
| | | | | | Total : | 40 303 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 140 633.

Enhanced Bond 6M

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|--------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 1 168 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 139 319 040 | (1 962 240) |
| EUR | 182 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 24 974 040 | (655 200) |
| EUR | 4 837 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 515 358 165 | 2 094 740 |
| | | | | | Total : | (522 700) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 2 251 062.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH)

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|----------------|------------|---------------------|--|
| GBP | 10 | V | FTSE 250 INDEX | 15/03/2024 | 507 294 | (27 956) |
| | | | | | Total : | (27 956) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD (374 101).

Euro Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 12 | A | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 1 700 640 | 115 320 |
| EUR | 26 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 3 567 720 | 1 450 |
| | | | | | Total : | 116 770 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (38 177).

Euro Bond Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 25 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 3 543 000 | 20 480 |
| EUR | 40 | A | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 5 260 400 | 152 000 |
| EUR | 44 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 5 248 320 | 60 910 |
| EUR | 59 | A | EURO-BTP FUTURE | 07/03/2024 | 7 029 850 | 221 840 |
| EUR | 27 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 3 704 940 | (2 320) |
| EUR | 100 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 10 654 500 | 16 500 |
| EUR | 53 | A | SHORT TERM EURO BTP FUTURES | 07/03/2024 | 5 652 450 | 38 690 |
| USD | 91 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 9 722 013 | (473 679) |
| USD | 68 | V | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 8 223 759 | (677 030) |
| USD | 338 | A | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 63 005 434 | 671 720 |
| USD | 163 | A | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 16 050 396 | 375 812 |
| JPY | 41 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 38 624 368 | (142 968) |
| AUD | 177 | A | AUST 10 YR BONDS FUTURE | 15/03/2024 | 12 619 265 | 368 982 |
| AUD | 222 | A | AUST 3 YR BONDS | 15/03/2024 | 14 405 422 | 148 112 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|----------------------|------------|---------------------|--|
| CAD | 148 | V | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 12 617 493 | (608 623) |
| CAD | 309 | V | CAN 2YR BOND | 19/03/2024 | 21 977 482 | (63 120) |
| | | | | | Total : | 107 306 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 2 238 854.

Euro Corporate Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 50 | A | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 7 086 000 | 474 000 |
| EUR | 1 000 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 119 280 000 | (1 680 000) |
| EUR | 299 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 41 028 780 | 571 410 |
| EUR | 1 192 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 127 001 640 | 584 080 |
| | | | | | Total : | (50 510) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 367 897.

Euro Corporate Bond Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 9 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 1 275 480 | (86 040) |
| EUR | 47 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 5 606 160 | 77 550 |
| EUR | 10 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 1 372 200 | 13 520 |
| EUR | 39 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 4 155 255 | 19 110 |
| | | | | | Total : | 24 140 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 56 874.

Euro Corporate Green Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 8 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 1 097 760 | (28 800) |
| EUR | 10 | V | SHORT TERM EURO BTP FUTURES | 07/03/2024 | 1 066 500 | (7 200) |
| EUR | 3 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 425 160 | (28 680) |
| EUR | 5 | V | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 657 550 | (19 050) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|-----------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 9 | V | EURO-BTP FUTURE | 07/03/2024 | 1 072 350 | (34 470) |
| Total : | | | | | | (118 200) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 244 344.

Euro Defensive Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|------------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 247 | A | EURO STOXX 50 - FUTURE | 15/03/2024 | 11 221 210 | (74 488) |
| Total : | | | | | | (74 488) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 5 594 195.

Euro Flexible Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 143 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 17 057 040 | (240 240) |
| EUR | 5 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 686 100 | (4 100) |
| EUR | 136 | V | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 17 885 360 | (354 000) |
| EUR | 627 | V | EURO-BTP FUTURE | 07/03/2024 | 74 707 050 | (1 786 971) |
| EUR | 1 754 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 186 879 930 | 623 585 |
| EUR | 836 | A | SHORT TERM EURO BTP FUTURES | 07/03/2024 | 89 159 400 | 347 360 |
| USD | 350 | V | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 35 768 541 | (712 188) |
| USD | 285 | V | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 28 063 577 | (647 015) |
| JPY | 529 | V | 10 YR MINI JGB FUTURE (SGX) | 12/03/2024 | 49 773 713 | (434 794) |
| Total : | | | | | | (3 208 363) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 7 468 629.

Euro Government Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 458 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 64 907 760 | (3 344 700) |
| EUR | 44 | A | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 5 786 440 | (15 610) |
| EUR | 2 371 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 282 812 880 | 3 533 811 |
| EUR | 471 | A | EURO-BTP FUTURE | 07/03/2024 | 56 119 650 | 392 202 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|--------------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 723 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 99 210 060 | (1 145 780) |
| EUR | 2 503 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 266 682 135 | (628 010) |
| GBP | 470 | A | LONG GILT FUTURE (LIFFE) | 26/03/2024 | 55 675 379 | 1 597 611 |
| Total : | | | | | | 389 524 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 5 547 865.

Euro Inflation-Linked Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|----------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 56 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 7 936 320 | (461 120) |
| EUR | 309 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 36 857 520 | 478 949 |
| EUR | 34 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 4 665 480 | (59 650) |
| EUR | 137 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 14 596 665 | (59 850) |
| JPY | 17 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 16 014 982 | (157 127) |
| CAD | 88 | V | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 7 502 293 | (9 467) |
| CAD | 445 | A | CAN 2YR BOND | 19/03/2024 | 31 650 419 | 262 440 |
| Total : | | | | | | (5 825) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 846 525.

Euro Medium Term Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 13 | A | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 1 709 630 | 24 180 |
| EUR | 339 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 40 435 920 | 488 640 |
| EUR | 59 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 6 286 155 | 29 145 |
| Total : | | | | | | 541 965 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (79 312).

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Euro Short Term Corporate Bond Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 40 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 5 668 800 | (382 400) |
| EUR | 482 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 57 492 960 | (809 760) |
| EUR | 950 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 101 217 750 | 418 225 |
| | | | | | Total : | (773 935) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 1 674 407.

Europe Convertible

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|-------------------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 50 | A | STOXX 600 REAL ESTATE (SX86P) | 15/03/2024 | 335 500 | 16 315 |
| | | | | | Total : | 16 315 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 9 133.

Global Absolute Return Multi-Factor Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| USD | 1 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 106 835 | (4 625) |
| AUD | 3 | A | AUST 10 YR BONDS FUTURE | 15/03/2024 | 215 264 | 3 371 |
| CAD | 1 | V | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 85 253 | (281) |
| | | | | | Total : | (1 535) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 11 133.

Global Bond Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 73 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 10 345 560 | 13 120 |
| EUR | 64 | A | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 8 416 640 | 241 920 |
| EUR | 91 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 10 854 480 | 150 140 |
| EUR | 15 | A | EURO-BTP FUTURE | 07/03/2024 | 1 787 250 | 56 400 |
| EUR | 45 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 6 174 900 | (77 190) |
| EUR | 64 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 6 818 880 | (320) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| USD | 228 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 24 358 451 | (1 177 494) |
| USD | 127 | V | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 15 359 079 | (1 149 613) |
| USD | 30 | A | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 3 065 875 | 36 656 |
| USD | 78 | A | US LONG BOND FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 8 821 912 | 613 939 |
| USD | 1 002 | A | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 186 779 423 | 1 991 312 |
| USD | 603 | A | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 59 376 620 | 1 386 230 |
| GBP | 66 | A | LONG GILT FUTURE (LIFFE) | 26/03/2024 | 7 818 245 | 191 533 |
| JPY | 99 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 93 263 719 | (867 732) |
| AUD | 512 | A | AUST 10 YR BONDS FUTURE | 15/03/2024 | 36 503 183 | 1 067 338 |
| AUD | 657 | A | AUST 3 YR BONDS | 15/03/2024 | 42 536 349 | 438 330 |
| CAD | 406 | V | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 34 612 852 | (1 669 601) |
| CAD | 823 | V | CAN 2YR BOND | 19/03/2024 | 58 535 494 | (152 712) |
| | | | | | Total : | 1 092 256 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 5 258 699.

Global Convertible

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|-------------------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 383 | A | STOXX 600 REAL ESTATE (SX86P) | 15/03/2024 | 2 838 874 | 138 076 |
| USD | 70 | A | S&P 500 E-MINI FUTURE | 15/03/2024 | 16 870 000 | 309 750 |
| JPY | 35 | A | NIKKEI 225 (OSE) | 07/03/2024 | 8 304 370 | 91 857 |
| | | | | | Total : | 539 683 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 567 920.

Global Enhanced Bond 36M

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 55 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 7 794 600 | 50 760 |
| EUR | 45 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 5 367 600 | (75 600) |
| EUR | 8 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 1 097 760 | (13 480) |
| EUR | 46 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 4 901 070 | (23 230) |
| EUR | 10 | V | SHORT TERM EURO BTP FUTURES | 07/03/2024 | 1 066 500 | (7 300) |
| USD | 91 | V | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 11 005 324 | (911 388) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| USD | 121 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 12 927 072 | (490 426) |
| USD | 140 | V | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 14 307 416 | (397 897) |
| USD | 191 | A | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 35 603 663 | 333 837 |
| USD | 85 | V | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 8 369 839 | (117 217) |
| JPY | 53 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 49 929 062 | (464 543) |
| AUD | 218 | A | AUST 10 YR BONDS FUTURE | 15/03/2024 | 15 542 371 | 454 452 |
| AUD | 319 | A | AUST 3 YR BONDS | 15/03/2024 | 20 711 132 | 212 813 |
| CAD | 182 | V | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 15 516 106 | (748 442) |
| CAD | 443 | V | CAN 2YR BOND | 19/03/2024 | 31 508 170 | (90 488) |
| | | | | | Total : | (2 288 149) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 6 148 700.

Global Inflation-Linked Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 51 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 7 227 720 | (311 780) |
| EUR | 281 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 33 517 680 | 416 350 |
| EUR | 85 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 11 663 700 | (148 630) |
| EUR | 127 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 13 531 215 | (52 685) |
| USD | 107 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 11 431 378 | (513 407) |
| USD | 91 | V | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 11 005 324 | (893 152) |
| USD | 112 | A | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 11 445 933 | 357 212 |
| USD | 2 | A | US LONG BOND FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 226 203 | 18 190 |
| USD | 61 | V | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 11 370 803 | (125 110) |
| USD | 315 | A | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 31 017 637 | 771 130 |
| JPY | 15 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 14 130 866 | (139 084) |
| CAD | 79 | V | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 6 735 013 | (8 492) |
| CAD | 402 | A | CAN 2YR BOND | 19/03/2024 | 28 592 064 | 244 659 |
| | | | | | Total : | (384 799) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 1 893 484.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Green Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 175 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 20 874 000 | (294 000) |
| Total : | | | | | | (294 000) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 576 743.

Multi-Asset Thematic

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---------------------------|------------|---------------------|--|
| USD | 481 | A | EURO FX CURR FUTURE (CME) | 18/03/2024 | 60 280 123 | 405 559 |
| JPY | 10 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 9 420 578 | (101 841) |
| Total : | | | | | | 303 718 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 803 469.

Social Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 26 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 3 684 720 | (248 560) |
| EUR | 36 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 4 939 920 | (105 790) |
| Total : | | | | | | (354 350) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 658 619.

Sustainable Enhanced Bond 12M

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|--------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 812 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 96 855 360 | (1 364 160) |
| EUR | 1 366 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 145 540 470 | (689 830) |
| Total : | | | | | | (2 053 990) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 4 496 697.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Euro Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|--------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 143 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 17 057 040 | (105 900) |
| EUR | 90 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 12 349 800 | 19 274 |
| EUR | 349 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 37 184 205 | 171 994 |
| Total : | | | | | | 85 368 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 404 790.

Sustainable Euro Corporate Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|-----------------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 4 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 566 880 | (38 240) |
| EUR | 30 | V | EURO-BTP FUTURE | 07/03/2024 | 3 574 500 | (114 900) |
| EUR | 20 | V | SHORT TERM EURO BTP FUTURES | 07/03/2024 | 2 133 000 | (14 400) |
| Total : | | | | | | (167 540) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 345 328.

Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 60 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 7 156 800 | (51 150) |
| EUR | 21 | A | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 2 976 120 | 127 200 |
| EUR | 16 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 2 195 520 | (42 080) |
| EUR | 157 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 16 727 565 | 35 415 |
| Total : | | | | | | 69 385 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (14 694).

Sustainable Euro Multi-Factor Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|------------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 55 | A | EURO STOXX 50 - FUTURE | 15/03/2024 | 2 498 650 | (14 600) |
| Total : | | | | | | (14 600) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 195 024.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Europe Multi-Factor Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|----------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 1 236 | A | MSCI EUROPE NR | 15/03/2024 | 38 495 220 | 268 474 |
| | | | | | Total : | 268 474 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 2 332 376.

Sustainable Global Corporate Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 1 | A | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 156 551 | 10 472 |
| EUR | 36 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 4 743 456 | (60 369) |
| EUR | 34 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 5 153 723 | 134 834 |
| USD | 164 | V | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 19 354 563 | (942 999) |
| USD | 19 | A | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 2 538 281 | 210 789 |
| USD | 160 | V | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 18 062 500 | (347 500) |
| USD | 125 | A | US LONG BOND FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 15 617 188 | 1 152 000 |
| USD | 121 | A | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 24 915 602 | 251 133 |
| USD | 75 | V | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 8 158 008 | (188 086) |
| | | | | | Total : | 220 274 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 387 832.

Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 17 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 2 239 965 | (18 370) |
| EUR | 3 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 454 740 | (8 683) |
| EUR | 2 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 235 390 | (851) |
| USD | 2 | A | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 236 031 | 11 031 |
| USD | 20 | V | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 2 257 813 | (77 187) |
| USD | 6 | A | US LONG BOND FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 749 625 | 56 813 |
| USD | 1 | A | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 205 914 | 1 438 |
| USD | 1 | A | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 108 773 | 2 547 |
| GBP | 12 | A | LONG GILT FUTURE (LIFFE) | 26/03/2024 | 1 570 258 | 99 585 |
| JPY | 3 | A | 10 YR MINI JGB FUTURE (SGX) | 12/03/2024 | 311 810 | 2 979 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|-------------------------|------------|---------------------|--|
| AUD | 2 | A | AUST 10 YR BONDS FUTURE | 15/03/2024 | 153 244 | 4 688 |
| CAD | 15 | A | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 1 412 626 | 67 799 |
| | | | | | Total : | 141 789 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 24 427.

Sustainable Global Multi-Factor Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|---------------|------------|---------------------|--|
| USD | 51 | A | MSCI WORLD NR | 15/03/2024 | 5 086 740 | 148 935 |
| | | | | | Total : | 148 935 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 167 108.

Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 2 | A | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 263 525 | 1 569 |
| EUR | 3 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 353 085 | (425) |
| USD | 3 | A | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 354 047 | 13 484 |
| USD | 1 | A | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 133 594 | 12 352 |
| USD | 7 | A | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 1 441 398 | 15 367 |
| USD | 18 | V | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 1 957 922 | (45 142) |
| GBP | 1 | A | LONG GILT FUTURE (LIFFE) | 26/03/2024 | 130 855 | 8 299 |
| CAD | 1 | A | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 94 175 | 4 520 |
| | | | | | Total : | 10 024 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 13 105.

Sustainable Japan Multi-Factor Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en JPY) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en JPY) |
|--------|----------|-----------------|-------------------|------------|---------------------|--|
| JPY | 10 | A | TOPIX INDX FUTURE | 07/03/2024 | 236 600 000 | (174 000) |
| | | | | | Total : | (174 000) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à JPY 12 104 352.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Multi-Asset Balanced

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 196 | A | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 27 777 120 | 1 881 600 |
| EUR | 101 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 12 047 280 | (169 680) |
| EUR | 5 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 686 100 | 140 |
| EUR | 44 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 4 687 980 | 23 100 |
| Total : | | | | | | 1 735 160 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (629 009).

Sustainable Multi-Asset Flexible

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| USD | 200 | A | EURO FX CURR FUTURE (CME) | 18/03/2024 | 25 064 500 | 164 078 |
| USD | 47 | A | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 5 684 068 | 525 527 |
| JPY | 6 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 5 652 347 | (61 130) |
| JPY | 19 | A | EURO/JAPANESE YEN FUTURES | 18/03/2024 | 2 353 595 | 11 438 |
| Total : | | | | | | 639 913 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 212 437.

Sustainable Multi-Asset Growth

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 102 | A | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 14 455 440 | 979 200 |
| EUR | 132 | V | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 14 063 940 | (66 660) |
| Total : | | | | | | 912 540 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (312 929).

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Multi-Asset Stability

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|----------------|----------|-----------------|---------------------|------------|---------------------|--|
| EUR | 155 | A | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 21 966 600 | 1 488 200 |
| EUR | 330 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 39 362 400 | (554 400) |
| EUR | 14 | V | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 1 921 080 | (32 060) |
| EUR | 98 | A | EURO-SCHATZ FUTURE | 07/03/2024 | 10 441 410 | 51 250 |
| Total : | | | | | | 952 990 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (248 602).

Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|----------------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| USD | 23 | A | ULTRA 10 YEAR US TREASURY NOTE FUTURES | 19/03/2024 | 2 714 359 | 108 297 |
| USD | 60 | V | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 8 015 625 | (644 140) |
| USD | 116 | V | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 13 095 313 | (399 313) |
| USD | 145 | A | US LONG BOND FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 18 115 938 | 1 357 969 |
| USD | 6 | A | US 2YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 1 235 484 | 8 625 |
| USD | 15 | V | US 5YR NOTE FUTURE (CBT) | 28/03/2024 | 1 631 602 | (3 164) |
| Total : | | | | | | 428 274 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD (138 382).

Sustainable US Multi-Factor Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|----------------|----------|-----------------|-----------------------|------------|---------------------|--|
| USD | 759 | A | S&P 500 E-MINI FUTURE | 15/03/2024 | 182 919 000 | 5 675 025 |
| Total : | | | | | | 5 675 025 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 3 711 908.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable US Value Multi-Factor Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|-----------------------|------------|---------------------|--|
| USD | 415 | A | S&P 500 E-MINI FUTURE | 15/03/2024 | 100 015 000 | 3 028 488 |
| | | | | | Total : | 3 028 488 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 2 104 025.

Target Risk Balanced

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en EUR) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|------------|---------------------|--|
| EUR | 140 | A | EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT BD 10YR 6% | 07/03/2024 | 18 411 400 | 537 600 |
| EUR | 194 | V | EURO-BOBL FUTURE | 07/03/2024 | 23 140 320 | (325 920) |
| EUR | 159 | A | EURO-BTP FUTURE | 07/03/2024 | 18 944 850 | 599 430 |
| EUR | 131 | A | EURO-BUND FUTURE | 07/03/2024 | 17 975 820 | 457 190 |
| USD | 931 | A | EURO FX CURR FUTURE (CME) | 18/03/2024 | 116 675 248 | 763 788 |
| USD | 470 | A | US 10YR NOTE FUTURE (CBT) | 19/03/2024 | 48 032 041 | 1 645 387 |
| | | | | | Total : | 3 677 475 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (341 696).

USD Short Duration Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Echéance | Nominal (en USD) | Plus/(moins)- value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|--|------------|---------------------|--|
| EUR | 16 | V | EURO BUXL 30Y BONDS | 07/03/2024 | 2 504 816 | 9 544 |
| USD | 49 | V | ULTRA LONG TERM US TREASURY BOND FUTURE | 19/03/2024 | 6 546 094 | (555 664) |
| JPY | 18 | V | JPN 10Y BOND (TSE) | 13/03/2024 | 18 731 594 | (104 553) |
| AUD | 106 | A | AUST 10 YR BONDS FUTURE | 15/03/2024 | 8 122 312 | 258 516 |
| CAD | 88 | V | CAN 10YR BOND FUTURE | 19/03/2024 | 8 287 406 | (331 311) |
| | | | | | Total : | (723 468) |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 1 904 152.

Courtiers pour les contrats futures :

BNP Paribas Securities Services Luxembourg
 BNP Paribas, France
 Goldman Sachs London Derivatives
 Société Générale

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Note 12 - Contrats de change à terme

Au 31 décembre 2023, le montant total acheté par devise et le montant total vendu par devise dans le cadre de contrats de change à terme étaient les suivants :

Aqua

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|--|--------------------|
| CAD | 491 600 | AUD | 1 289 400 |
| CHF | 1 175 900 | CAD | 1 371 300 |
| CNH | 6 522 580 | CHF | 3 344 300 |
| CZK | 5 111 048 560 | CNH | 3 432 760 |
| DKK | 2 837 100 | CZK | 2 527 205 780 |
| EUR | 204 897 157 | DKK | 7 990 400 |
| GBP | 2 167 500 | EUR | 340 427 748 |
| HKD | 20 270 | GBP | 6 167 100 |
| JPY | 112 114 000 | HKD | 10 030 |
| SEK | 4 976 300 | JPY | 302 814 400 |
| SGD | 17 780 800 | KRW | 580 126 500 |
| USD | 123 089 210 | SEK | 14 258 300 |
| | | SGD | 9 119 230 |
| | | USD | 84 693 660 |
| | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (1 633 858) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Asia Tech Innovators

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|--|--------------------|
| CZK | 2 500 310 | CZK | 1 192 180 |
| SGD | 28 490 | SGD | 14 160 |
| USD | 63 906 | USD | 133 337 |
| | | Moins-value nette non réalisée (en USD) | (96) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

China Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| CNY | 292 400 | CNY | 6 820 400 |
| EUR | 5 344 025 | EUR | 1 233 671 |
| HKD | 1 830 200 | HKD | 17 579 500 |
| SGD | 29 567 480 | SGD | 15 165 200 |
| USD | 12 491 724 | TWD | 4 231 900 |
| | | USD | 24 671 341 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 221 292 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Climate Impact

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 2 271 800 | AUD | 3 311 170 |
| CHF | 303 990 | CAD | 2 426 600 |
| CNH | 1 098 220 | CHF | 147 410 |
| EUR | 52 473 076 | CNH | 528 410 |
| GBP | 11 092 180 | DKK | 18 854 000 |
| HKD | 19 120 | EUR | 366 857 |
| SGD | 3 454 090 | GBP | 9 869 280 |
| USD | 9 703 417 | HKD | 8 593 030 |
| | | JPY | 402 180 700 |
| | | NOK | 4 767 500 |
| | | SEK | 7 269 200 |
| | | SGD | 1 766 810 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| | | TWD | 58 722 300 |
| | | USD | 56 962 735 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 937 663 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Consumer Innovators

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| EUR | 26 801 932 | CAD | 703 700 |
| SGD | 17 610 | EUR | 569 358 |
| USD | 612 400 | GBP | 239 600 |
| | | HKD | 2 925 000 |
| | | JPY | 359 396 100 |
| | | SGD | 8 710 |
| | | USD | 25 255 500 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 536 471 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Disruptive Technology

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| EUR | 449 297 262 | DKK | 34 034 500 |
| USD | 94 723 450 | EUR | 87 945 111 |
| | | JPY | 765 211 700 |
| | | USD | 475 151 150 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 7 738 828 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Ecosystem Restoration

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| CNH | 72 790 | CAD | 6 772 000 |
| CZK | 14 451 650 | CNH | 34 740 |
| DKK | 13 871 000 | CNY | 8 544 000 |
| EUR | 83 869 536 | CZK | 6 730 680 |
| GBP | 7 050 | DKK | 37 086 000 |
| JPY | 53 614 502 | EUR | 20 972 766 |
| MXN | 24 220 000 | GBP | 8 740 |
| SEK | 3 798 000 | INR | 131 236 000 |
| SGD | 6 970 | JPY | 576 116 639 |
| USD | 17 839 000 | MXN | 53 067 000 |
| | | NOK | 12 820 000 |
| | | SEK | 3 800 000 |
| | | SGD | 3 300 |
| | | USD | 68 305 716 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 1 241 751 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Emerging Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| AUD | 1 339 390 | AUD | 660 260 |
| EUR | 494 945 660 | EUR | 256 175 590 |
| USD | 280 054 688 | USD | 542 264 136 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 2 409 111 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Emerging Bond Opportunities

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 4 818 860 | AUD | 2 355 630 |
| BRL | 65 253 465 | BRL | 59 611 867 |
| CLP | 1 715 948 000 | CLP | 1 156 746 979 |
| CNH | 832 340 | CNH | 411 450 |
| COP | 4 826 337 000 | CZK | 12 575 000 |
| CZK | 52 583 322 | EGP | 112 382 379 |
| EGP | 43 080 000 | EUR | 39 942 159 |
| EUR | 65 175 589 | HKD | 15 382 590 |
| HKD | 31 133 820 | HUF | 237 680 000 |
| HUF | 770 233 476 | IDR | 73 048 757 000 |
| IDR | 122 941 903 721 | KRW | 1 700 000 000 |
| INR | 159 575 000 | MXN | 102 943 204 |
| KRW | 3 450 000 000 | PEN | 14 565 000 |
| MXN | 184 299 000 | PLN | 7 644 554 |
| PEN | 14 565 000 | RON | 30 322 468 |
| PLN | 14 574 425 | RUB | 168 044 000 |
| RON | 31 815 337 | SGD | 91 250 |
| SGD | 184 840 | THB | 45 014 000 |
| THB | 194 979 500 | TRY | 21 882 000 |
| TRY | 21 851 244 | USD | 146 414 084 |
| USD | 95 910 823 | ZAR | 86 571 690 |
| ZAR | 73 302 155 | | |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 779 541 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Energy Transition

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 27 567 000 | AUD | 46 820 000 |
| CHF | 17 702 000 | BRL | 61 040 000 |
| CNH | 143 850 210 | CAD | 38 677 000 |
| DKK | 363 825 000 | CHF | 42 160 000 |
| EUR | 2 203 525 218 | CNH | 463 338 490 |
| GBP | 17 720 | DKK | 633 231 000 |
| HKD | 149 478 110 | EUR | 1 015 125 356 |
| INR | 4 551 601 000 | GBP | 192 210 |
| SGD | 18 108 930 | HKD | 493 521 180 |
| USD | 894 250 933 | INR | 5 338 667 000 |
| | | KRW | 12 436 186 000 |
| | | NOK | 277 391 000 |
| | | SEK | 32 416 000 |
| | | SGD | 8 730 990 |
| | | USD | 1 923 043 896 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 26 353 216 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH)

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CZK | 147 103 280 | CZK | 70 417 260 |
| EUR | 15 359 840 | EUR | 7 350 420 |
| SGD | 9 460 | SGD | 4 520 |
| USD | 11 176 736 | USD | 23 399 623 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 68 564 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Euro Bond Opportunities

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 36 868 949 | AUD | 35 331 991 |
| BRL | 13 916 000 | BRL | 2 318 000 |
| CAD | 14 307 630 | CAD | 11 235 672 |
| CHF | 3 372 904 | CHF | 8 833 310 |
| CNY | 17 034 695 | CNY | 23 890 222 |
| COP | 5 873 331 000 | COP | 1 919 656 000 |
| CZK | 1 104 000 | CZK | 3 433 000 |
| EUR | 92 633 076 | EUR | 49 478 082 |
| GBP | 9 675 872 | GBP | 19 301 268 |
| HUF | 823 971 914 | HUF | 491 485 517 |
| JPY | 6 194 290 068 | JPY | 4 429 511 872 |
| KRW | 4 425 013 000 | KRW | 4 410 164 000 |
| MXN | 209 378 116 | MXN | 186 040 590 |
| MYR | 8 866 000 | MYR | 8 765 000 |
| NOK | 72 355 580 | NOK | 72 110 959 |
| NZD | 5 399 585 | NZD | 5 079 448 |
| PEN | 6 833 000 | PEN | 15 719 000 |
| RON | 7 499 000 | PLN | 270 000 |
| SEK | 60 977 695 | RON | 19 332 000 |
| THB | 66 891 000 | SEK | 60 850 610 |
| TWD | 105 023 000 | THB | 66 710 000 |
| USD | 64 200 616 | TWD | 104 542 000 |
| ZAR | 75 260 073 | USD | 103 995 625 |
| | | ZAR | 140 105 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 1 286 696 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 30 janvier 2024.

Euro Corporate Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| CZK | 261 245 800 | CZK | 129 670 590 |
| EUR | 5 296 069 | EUR | 10 687 891 |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | (76 969) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Euro Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| CZK | 119 810 950 | CZK | 1 363 531 |
| EUR | 67 500 | EUR | 5 271 500 |
| USD | 512 041 | USD | 132 447 |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | (69 119) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 18 janvier 2024.

Euro High Yield Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 108 816 847 | EUR | 3 444 691 |
| USD | 3 731 100 | GBP | 85 262 000 |
| | | USD | 11 222 940 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 263 613 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Euro High Yield Short Duration Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CHF | 1 788 000 | CHF | 1 789 000 |
| EUR | 84 049 204 | EUR | 19 103 187 |
| GBP | 358 000 | GBP | 39 281 000 |
| USD | 18 346 490 | USD | 39 612 690 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 813 365 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Euro Inflation-Linked Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 5 365 511 | AUD | 1 619 762 |
| | | CAD | 656 000 |
| | | GBP | 3 149 000 |
| | | USD | 309 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 5 852 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 31 janvier 2024.

Europe Convertible

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 9 462 489 | CHF | 727 000 |
| SEK | 5 634 000 | EUR | 2 423 350 |
| USD | 2 066 000 | GBP | 2 270 000 |
| | | SEK | 5 634 000 |
| | | USD | 5 947 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 127 831 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 18 janvier 2024.

Europe Growth

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 1 420 350 | EUR | 2 849 201 |
| SGD | 1 146 620 | SGD | 571 390 |
| USD | 2 254 820 | USD | 1 122 320 |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | (10 415) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Europe Small Cap

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 3 538 686 | EUR | 6 824 501 |
| SGD | 329 610 | SGD | 222 900 |
| USD | 7 216 000 | USD | 3 700 300 |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | (34 660) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Flexible Global Credit

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 6 679 405 | EUR | 373 098 |
| JPY | 58 350 716 | USD | 7 340 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 38 383 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 15 janvier 2024.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Global Absolute Return Multi-Factor Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 24 000 | AUD | 54 000 |
| CAD | 112 000 | CAD | 117 000 |
| EUR | 209 494 | EUR | 140 844 |
| GBP | 24 000 | GBP | 51 000 |
| USD | 24 000 | USD | 41 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 198 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 31 janvier 2024.

Global Bond Opportunities

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 85 864 785 | AUD | 86 662 200 |
| BRL | 28 267 000 | BRL | 5 079 600 |
| CAD | 35 982 520 | CAD | 40 422 102 |
| CHF | 7 056 506 | CHF | 20 337 251 |
| CNH | 86 779 893 | CLP | 130 984 083 |
| COP | 11 833 705 000 | CNH | 344 453 514 |
| EUR | 426 147 234 | COP | 5 040 420 168 |
| GBP | 27 779 077 | CZK | 23 447 000 |
| HUF | 1 704 861 874 | EUR | 164 093 104 |
| IDR | 3 179 808 000 | GBP | 46 259 361 |
| JPY | 13 699 350 110 | HUF | 1 122 194 560 |
| KRW | 9 071 164 000 | IDR | 27 841 526 960 |
| MXN | 532 941 369 | ILS | 1 430 000 |
| MYR | 17 942 000 | JPY | 13 281 997 797 |
| NOK | 149 726 055 | KRW | 15 348 533 000 |
| NZD | 14 153 803 | MXN | 508 276 484 |
| PEN | 24 353 000 | MYR | 17 935 000 |
| RON | 20 510 000 | NOK | 149 854 163 |
| SEK | 130 144 961 | NZD | 14 781 245 |
| SGD | 116 000 | PEN | 49 006 000 |
| THB | 142 429 000 | PLN | 4 729 000 |
| TWD | 210 888 000 | RON | 55 695 430 |
| USD | 230 174 090 | SEK | 137 867 618 |
| ZAR | 150 055 228 | SGD | 1 173 000 |
| | | THB | 180 818 000 |
| | | TWD | 213 030 000 |
| | | USD | 407 948 611 |
| | | ZAR | 341 657 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 6 981 243 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 31 janvier 2024.

Global Convertible

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| CZK | 453 099 570 | CHF | 1 757 438 |
| EUR | 719 099 979 | CZK | 223 007 980 |
| GBP | 1 300 000 | EUR | 444 218 634 |
| NOK | 4 073 530 | GBP | 2 801 792 |
| PLN | 281 560 | HKD | 25 508 183 |
| USD | 529 640 681 | JPY | 3 387 220 145 |
| | | NOK | 1 936 810 |
| | | PLN | 138 370 |
| | | SGD | 5 194 077 |
| | | USD | 809 279 778 |
| Moins-value nette non réalisée (en USD) | | | (152 224) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Global Enhanced Bond 36M

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 37 554 123 | AUD | 37 630 727 |
| BRL | 10 769 000 | BRL | 1 788 000 |
| CAD | 14 637 101 | CAD | 12 547 720 |
| CHF | 2 686 028 | CHF | 9 273 902 |
| CNY | 13 033 463 | CNY | 18 637 057 |
| COP | 4 620 173 000 | COP | 1 496 118 000 |
| CZK | 265 687 190 | CZK | 130 857 830 |
| EUR | 139 449 429 | EUR | 62 147 177 |
| GBP | 10 493 517 | GBP | 22 345 198 |
| HUF | 663 586 326 | HUF | 382 528 346 |
| JPY | 6 042 748 614 | JPY | 4 852 143 373 |
| KRW | 3 412 328 000 | KRW | 3 388 437 000 |
| MXN | 108 378 922 | MXN | 171 200 291 |
| MYR | 6 914 000 | MYR | 6 773 000 |
| NOK | 58 247 978 | NOK | 58 306 676 |
| NZD | 6 185 062 | NZD | 6 467 727 |
| PEN | 5 131 000 | PEN | 17 316 000 |
| RON | 7 572 000 | RON | 20 056 000 |
| SEK | 48 927 240 | SEK | 50 069 332 |
| THB | 51 709 000 | THB | 51 030 000 |
| TWD | 86 731 000 | TWD | 84 237 000 |
| USD | 57 738 853 | USD | 121 949 905 |
| ZAR | 57 953 040 | ZAR | 149 013 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 1 951 977 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Global Environment

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CNH | 1 589 450 | CNH | 873 320 |
| EUR | 82 782 931 | DKK | 40 352 400 |
| HKD | 19 090 | EUR | 152 154 633 |
| JPY | 43 037 168 991 | GBP | 18 363 600 |
| SGD | 47 337 630 | HKD | 9 360 |
| USD | 75 022 260 | JPY | 2 153 588 896 |
| | | SGD | 24 122 490 |
| | | TWD | 408 593 400 |
| | | USD | 260 145 060 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 3 589 878 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Global High Yield Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 4 830 260 | AUD | 2 381 460 |
| CZK | 452 779 990 | CZK | 223 660 680 |
| EUR | 93 773 706 | EUR | 51 934 508 |
| GBP | 268 000 | GBP | 4 043 000 |
| USD | 32 752 130 | USD | 84 129 200 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 1 772 431 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Global Inflation-Linked Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 16 503 768 | AUD | 25 786 926 |
| CAD | 7 464 787 | CAD | 17 385 725 |
| CHF | 2 384 462 | CHF | 3 554 858 |
| EUR | 833 795 519 | DKK | 3 460 971 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| GBP | 5 556 756 | EUR | 815 905 786 |
| HUF | 587 361 818 | GBP | 109 602 490 |
| JPY | 1 594 242 400 | HUF | 356 531 555 |
| MXN | 34 912 613 | JPY | 2 177 607 943 |
| NOK | 14 605 000 | MXN | 17 834 643 |
| NZD | 2 000 | NOK | 14 605 000 |
| SEK | 28 803 102 | NZD | 3 511 435 |
| SGD | 1 144 541 070 | SEK | 56 365 531 |
| USD | 175 213 312 | SGD | 570 502 630 |
| | | USD | 467 946 783 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 6 111 965 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Green Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| AUD | 4 946 150 | AUD | 28 752 930 |
| CAD | 23 357 000 | CAD | 84 287 000 |
| EUR | 398 510 536 | DKK | 42 831 000 |
| SEK | 93 016 000 | EUR | 27 005 959 |
| | | GBP | 88 580 000 |
| | | SEK | 185 820 000 |
| | | USD | 212 140 000 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 6 854 902 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Green Tigers

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| AUD | 646 700 | AUD | 5 325 700 |
| CNH | 7 657 210 | CNH | 3 957 830 |
| EUR | 33 559 268 | CNY | 20 481 800 |
| GBP | 805 410 | EUR | 4 598 042 |
| HKD | 4 765 900 | GBP | 397 090 |
| INR | 27 279 500 | HKD | 37 202 500 |
| JPY | 130 975 700 | INR | 292 449 900 |
| KRW | 435 372 300 | JPY | 1 026 133 300 |
| SGD | 2 045 430 | KRW | 3 850 897 300 |
| TWD | 34 654 000 | SGD | 1 545 020 |
| USD | 3 123 787 | THB | 15 798 500 |
| | | TWD | 237 805 500 |
| | | USD | 6 650 209 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 359 890 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Health Care Innovators

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| EUR | 97 101 017 | CHF | 2 643 000 |
| USD | 1 087 800 | DKK | 30 758 800 |
| | | EUR | 989 855 |
| | | GBP | 5 636 500 |
| | | JPY | 310 602 000 |
| | | USD | 88 233 200 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 1 810 029 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 18 janvier 2024.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Inclusive Growth

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CNH | 211 540 | CAD | 343 300 |
| EUR | 12 427 674 | CHF | 468 800 |
| SGD | 30 060 | CNH | 105 020 |
| USD | 254 100 | EUR | 278 600 |
| | | GBP | 968 800 |
| | | JPY | 33 453 300 |
| | | SGD | 14 920 |
| | | USD | 11 152 900 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 241 369 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Japan Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|----------------------|
| EUR | 176 050 640 | EUR | 94 265 870 |
| JPY | 14 720 341 829 | JPY | 28 020 160 177 |
| USD | 2 555 910 | USD | 1 282 980 |
| Moins-value nette non réalisée (en JPY) | | | (441 033 185) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Japan Small Cap

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|----------------------|
| EUR | 181 494 220 | EUR | 91 584 060 |
| JPY | 17 269 455 443 | JPY | 34 713 710 415 |
| USD | 43 199 100 | USD | 22 350 910 |
| Moins-value nette non réalisée (en JPY) | | | (582 178 269) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Local Emerging Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| BRL | 51 024 149 | BRL | 48 833 286 |
| CLP | 1 718 359 980 | CLP | 882 264 645 |
| CNH | 3 318 250 | COP | 2 468 408 000 |
| CZK | 50 157 000 | EGP | 82 656 590 |
| EGP | 66 950 000 | EUR | 39 516 830 |
| EUR | 75 861 921 | HUF | 183 770 000 |
| HUF | 778 692 369 | IDR | 48 986 840 000 |
| IDR | 85 748 786 000 | KRW | 1 250 000 000 |
| INR | 142 910 000 | MXN | 61 505 432 |
| KRW | 2 600 000 000 | PEN | 12 985 000 |
| MXN | 153 357 500 | PLN | 1 963 982 |
| PEN | 12 961 000 | RON | 20 753 855 |
| PLN | 10 430 342 | RUB | 20 798 000 |
| RON | 27 169 288 | THB | 19 172 000 |
| THB | 166 297 750 | USD | 136 776 790 |
| TRY | 735 000 | ZAR | 73 742 653 |
| USD | 77 153 960 | | |
| ZAR | 34 049 796 | | |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 1 377 642 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Multi-Asset Opportunities

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 1 117 280 | AUD | 551 530 |
| CNH | 23 070 080 | CNH | 11 397 800 |
| EUR | 1 084 270 | EUR | 545 490 |
| SGD | 1 129 180 | SGD | 556 950 |
| USD | 2 984 581 | USD | 6 019 820 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 24 735 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Multi-Asset Thematic

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 6 312 540 | AUD | 3 348 590 |
| CAD | 945 740 | CAD | 464 300 |
| CNH | 2 048 890 | CNH | 1 005 750 |
| CZK | 24 563 460 | CZK | 11 940 800 |
| EUR | 22 409 680 | EUR | 26 029 424 |
| HKD | 11 521 680 | GBP | 8 096 000 |
| SGD | 5 053 490 | HKD | 5 653 380 |
| USD | 16 908 260 | SGD | 2 481 050 |
| | | USD | 8 341 320 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 47 982 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 27 février 2024.

Nordic Small Cap

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CZK | 30 745 720 | CZK | 15 214 260 |
| DKK | 59 392 000 | DKK | 101 361 200 |
| EUR | 30 590 409 | EUR | 28 377 753 |
| NOK | 378 735 485 | NOK | 146 935 000 |
| SEK | 149 033 000 | SEK | 336 231 300 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 1 050 433 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

RMB Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 29 736 | CNY | 19 137 600 |
| EUR | 881 541 | EUR | 380 720 |
| HKD | 27 290 | USD | 831 281 |
| SGD | 29 233 | | |
| USD | 2 929 201 | | |
| Moins-value nette non réalisée (en USD) | | | (4 770) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Russia Equity (VNI suspendue)

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 1 119 389 | EUR | 2 216 146 |
| ZAR | 45 538 120 | ZAR | 22 769 060 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 25 047 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

SMaRT Food

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|--------|--------------------|
| CHF | 83 935 640 | AUD | 808 100 |
| EUR | 151 290 009 | CAD | 846 000 |
| GBP | 40 168 870 | CHF | 43 446 700 |
| USD | 148 571 941 | DKK | 3 390 900 |
| | | EUR | 269 945 320 |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| | | GBP | 20 203 730 |
| | | HKD | 1 943 200 |
| | | INR | 56 797 600 |
| | | JPY | 65 801 000 |
| | | NOK | 18 888 300 |
| | | PHP | 24 384 600 |
| | | USD | 85 045 900 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 542 495 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Social Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CHF | 6 257 720 | CHF | 3 098 300 |
| EUR | 11 740 361 | EUR | 6 699 279 |
| USD | 125 780 | USD | 9 042 490 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 381 506 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Asia ex-Japan Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 72 730 | AUD | 36 380 |
| EUR | 1 709 100 | EUR | 855 070 |
| SGD | 75 930 | SGD | 37 980 |
| USD | 987 645 | USD | 1 976 155 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 9 944 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Asian Cities Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 3 444 700 | AUD | 1 719 850 |
| CNH | 11 705 180 | CNH | 5 847 310 |
| EUR | 152 890 | EUR | 79 250 |
| HKD | 2 462 670 | HKD | 1 229 830 |
| SGD | 1 187 200 | SGD | 592 630 |
| USD | 2 666 264 | USD | 5 315 839 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 44 087 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Enhanced Bond 12M

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CHF | 59 230 | CHF | 29 570 |
| EUR | 59 943 | EUR | 119 999 |
| USD | 63 110 | USD | 31 480 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 512 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Euro Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 11 523 124 | EUR | 23 244 597 |
| GBP | 11 913 650 | GBP | 5 898 980 |
| USD | 10 345 090 | USD | 5 121 840 |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | (68 238) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Euro Corporate Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| CHF | 249 060 | CHF | 137 330 |
| EUR | 6 565 238 | EUR | 262 011 |
| | | USD | 6 847 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 230 153 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| CZK | 87 811 700 | CZK | 42 469 110 |
| EUR | 1 734 544 | EUR | 3 591 245 |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | (25 132) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Europe Dividend

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 682 811 | EUR | 1 365 429 |
| USD | 1 493 430 | USD | 746 220 |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | (7 197) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Europe Value

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 23 136 880 | EUR | 101 638 612 |
| GBP | 88 400 000 | GBP | 19 900 000 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 371 294 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 5 mars 2024.

Sustainable Global Corporate Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| CHF | 50 860 | CHF | 24 920 |
| CNH | 539 460 | CNH | 265 040 |
| EUR | 275 569 239 | EUR | 309 846 994 |
| NOK | 59 260 | NOK | 29 010 |
| USD | 334 304 621 | USD | 301 658 385 |
| Moins-value nette non réalisée (en USD) | | | (5 056 689) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Global Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| NOK | 187 311 377 | EUR | 1 449 200 |
| USD | 490 167 | GBP | 982 300 |
| | | HKD | 2 091 500 |
| | | INR | 12 292 600 |
| | | JPY | 180 112 900 |
| | | KRW | 184 485 100 |
| | | NOK | 5 116 364 |
| | | SGD | 290 500 |
| | | TWD | 5 374 900 |
| | | USD | 12 286 275 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 1 062 026 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Global Low Vol Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 421 400 | AUD | 2 389 000 |
| CHF | 337 800 | CAD | 6 695 100 |
| CNH | 205 300 | CHF | 1 411 600 |
| CZK | 20 406 876 | CNH | 101 670 |
| EUR | 21 726 876 | CZK | 703 629 |
| HKD | 39 750 | EUR | 993 923 |
| USD | 392 190 | GBP | 1 056 300 |
| | | HKD | 19 680 |
| | | JPY | 536 634 200 |
| | | SGD | 721 100 |
| | | USD | 10 576 727 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 200 974 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 75 362 350 | CAD | 103 000 |
| USD | 59 745 591 | EUR | 54 416 070 |
| | | GBP | 109 000 |
| | | USD | 82 284 283 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 422 401 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Global Multi-Factor Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 17 571 810 | EUR | 8 668 160 |
| USD | 9 477 759 | USD | 19 227 052 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 100 797 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| CZK | 809 210 | CZK | 384 760 |
| USD | 5 265 754 | EUR | 4 751 000 |
| | | GBP | 37 000 |
| | | USD | 36 220 |
| Moins-value nette non réalisée (en USD) | | | (53 151) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Multi-Asset Balanced

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 108 290 | AUD | 53 330 |
| CAD | 109 430 | CAD | 53 860 |
| EUR | 16 974 037 | EUR | 21 411 602 |
| HKD | 106 680 | HKD | 52 500 |
| SGD | 229 850 | SGD | 164 520 |
| USD | 23 080 810 | USD | 18 268 340 |
| Plus-value nette non réalisée (en EUR) | | | 27 896 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable Multi-Asset Flexible

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 4 336 123 | BRL | 2 806 400 |
| USD | 8 004 900 | EUR | 7 392 439 |
| | | GBP | 1 168 400 |
| | | HKD | 2 768 300 |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|--|--------------------|
| | | IDR | 10 228 182 500 |
| | | KRW | 852 375 200 |
| | | TWD | 3 638 700 |
| | | USD | 871 500 |
| | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (102 435) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 18 janvier 2024.

Sustainable Multi-Asset Growth

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| AUD | 18 110 | AUD | 9 020 |
| CAD | 18 550 | CAD | 9 240 |
| EUR | 2 865 956 | EUR | 181 190 |
| HKD | 18 340 | HKD | 9 110 |
| SGD | 153 920 | SGD | 76 470 |
| USD | 54 390 | USD | 3 026 730 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 60 763 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| EUR | 177 997 900 | EUR | 87 635 490 |
| USD | 95 820 575 | USD | 194 757 690 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 1 030 632 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable US Multi-Factor Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| EUR | 166 457 910 | EUR | 83 214 620 |
| USD | 90 986 799 | USD | 182 130 204 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 948 487 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Sustainable US Value Multi-Factor Equity

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| CZK | 3 290 860 | CZK | 1 620 180 |
| EUR | 67 704 990 | EUR | 33 505 800 |
| USD | 36 707 574 | USD | 74 226 410 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 390 317 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Target Risk Balanced

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| BRL | 11 193 680 | BRL | 5 535 190 |
| EUR | 1 463 555 | EUR | 2 943 795 |
| USD | 952 690 | USD | 468 530 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 3 594 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

US Growth

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--------|--------------------|---|--------------------|
| CZK | 846 888 482 | CZK | 11 462 128 |
| EUR | 134 072 312 | EUR | 2 256 088 |
| USD | 2 993 300 | GBP | 1 584 300 |
| | | USD | 180 384 900 |
| | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 3 668 255 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 18 janvier 2024.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

US High Yield Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| AUD | 2 761 380 | AUD | 1 365 350 |
| EUR | 5 604 970 | EUR | 3 083 830 |
| USD | 4 289 015 | USD | 7 975 540 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 56 269 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

US Mid Cap

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 13 464 880 | EUR | 6 635 820 |
| SGD | 118 410 | SGD | 57 670 |
| USD | 7 291 203 | USD | 14 817 546 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 74 747 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

US Small Cap

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|---|--------------------|--------|--------------------|
| EUR | 140 463 890 | EUR | 62 434 610 |
| SGD | 439 930 | SGD | 209 070 |
| USD | 68 374 512 | USD | 154 058 545 |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | 814 816 |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

USD Short Duration Bond

| Devise | Montant des achats | Devise | Montant des ventes |
|--|--------------------|--------|--------------------|
| CAD | 2 380 000 | AUD | 370 000 |
| EUR | 50 556 240 | CAD | 2 674 000 |
| GBP | 3 690 000 | EUR | 26 057 310 |
| JPY | 406 878 000 | GBP | 12 721 000 |
| NZD | 5 800 000 | JPY | 422 000 000 |
| USD | 52 898 997 | NZD | 5 990 000 |
| | | USD | 67 919 598 |
| Moins-value nette non réalisée (en USD) | | | (133 962) |

Au 31 décembre 2023, l'échéance maximale de tous les contrats ouverts est le 7 février 2024.

Contreparties aux contrats de change à terme :

Bank of America Securities Europe
 Barclays Bank Ireland Plc
 BNP Paribas Paris
 BNP Paribas Securities Services Luxembourg
 Citigroup Global Market
 Goldman Sachs International
 Goldman Sachs International London
 HSBC France
 JP Morgan
 JP Morgan Chase Bank
 Morgan Stanley Bank AG
 Morgan Stanley Europe
 Royal Bank of Canada
 Société Générale
 State Street Boston FX

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Note 13 - Swaps

Credit Default Swaps

La Société a conclu des contrats de credit default swap par le biais desquels elle échange des revenus fixes contre des revenus liés à l'évolution des événements de crédit d'un indice ou d'une obligation et inversement (voir détails dans le tableau ci-après). Ces montants sont calculés et constatés à chaque calcul de la Valeur nette d'inventaire. Le montant des plus-values non réalisées est inclus dans la rubrique « Plus-values nettes non réalisées sur instruments financiers » de l'état des actifs nets et le montant des moins-values nettes non réalisées est inclus dans la rubrique « Moins-values nettes non réalisées sur instruments financiers » de l'Etat des actifs nets.

Asia High Yield Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|----------------------------------|
| 4 500 000 | USD | 20/06/2028 | 1,000% | REP OF KOREA 2,75% 17-19/01/2027 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en USD) | (137 348) |

Emerging Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|-------------------------------------|---|
| 22 000 000 | USD | 20/06/2028 | 1,000% | REP OF KOREA 2,75% 17-19/01/2027 |
| 1 800 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 3 000 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 6 000 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 13 000 000 | USD | 20/12/2026 | 1,000% | CHINA (PEOPLES) 7,5% 97-20/06/2023 |
| 20 000 000 | USD | 20/12/2026 | 1,000% | CHINA (PEOPLES) 7,5% 97-20/06/2023 |
| 25 000 000 | USD | 20/12/2026 | 1,000% | CHINA (PEOPLES) 7,5% 97-20/06/2023 |
| 1 200 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 4 200 000 | USD | 20/12/2026 | TURKEY REP OF 11,875% 00-15/01/2030 | 1,000% |
| 4 200 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 2 100 000 | USD | 20/06/2027 | 1,000% | TURKEY REP OF 11,875% 00-15/01/2030 |
| 2 100 000 | USD | 20/06/2027 | 1,000% | TURKEY REP OF 11,875% 00-15/01/2030 |
| 4 500 000 | USD | 20/06/2027 | ARAB REP EGYPT 4,55% 19-20/11/2023 | 1,000% |
| 8 000 000 | EUR | 20/12/2027 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S38 5Y CORP 20/12/2027 |
| 8 000 000 | EUR | 20/12/2027 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S38 5Y CORP 20/12/2027 |
| 10 000 000 | USD | 20/12/2027 | 1,000% | CDX EM CDSI S38 5Y PRC CORP 20/12/2027 |
| 25 000 000 | USD | 20/12/2027 | 1,000% | CDX EM CDSI S38 5Y PRC CORP 20/12/2027 |
| 8 400 000 | USD | 20/12/2027 | 1,000% | UNITED MEXICAN 4,15% 17-28/03/2027 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------------------------|
| 16 000 000 | USD | 20/12/2028 | 1,000% | UNITED MEXICAN 4,15% 17-28/03/2027 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en USD) | (13 153 444) |

Emerging Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 2 600 000 | USD | 20/12/2024 | REPSOU CDS USD SR 5Y D14 20/12/2024 | 1,000% |
| 15 000 000 | USD | 20/06/2028 | 1,000% | REP OF KOREA 2,75% 17-19/01/2027 |
| 900 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 1 400 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 2 800 000 | USD | 20/12/2026 | TURKEY REP OF 11,875% 00-15/01/2030 | 1,000% |
| 2 800 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 4 000 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 4 500 000 | USD | 20/12/2026 | 1,000% | CHINA (PEOPLES) 7,5% 97-20/06/2023 |
| 15 000 000 | USD | 20/12/2026 | 1,000% | CHINA (PEOPLES) 7,5% 97-20/06/2023 |
| 18 000 000 | USD | 20/12/2026 | 1,000% | CHINA (PEOPLES) 7,5% 97-20/06/2023 |
| 2 300 000 | USD | 20/12/2026 | ARGENTINA 1% 20-20/12/2026 | 5,000% |
| 1 400 000 | USD | 20/06/2027 | 1,000% | TURKEY REP OF 11,875% 00-15/01/2030 |
| 1 400 000 | USD | 20/06/2027 | 1,000% | TURKEY REP OF 11,875% 00-15/01/2030 |
| 3 000 000 | USD | 20/06/2027 | ARAB REP EGYPT 4,55% 19-20/11/2023 | 1,000% |
| 5 000 000 | EUR | 20/12/2027 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S38 5Y CORP 20/12/2027 |
| 5 600 000 | USD | 20/12/2027 | 1,000% | UNITED MEXICAN 4,15% 17-28/03/2027 |
| 15 000 000 | USD | 20/12/2027 | 1,000% | CDX EM CDSI S38 5Y PRC CORP 20/12/2027 |
| 8 000 000 | USD | 20/12/2027 | 1,000% | CDX EM CDSI S38 5Y PRC CORP 20/12/2027 |
| 10 000 000 | USD | 20/12/2028 | 1,000% | UNITED MEXICAN 4,15% 17-28/03/2027 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en USD) | (8 461 918) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Multi-Asset Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|---------------|
| 2 200 000 | EUR | 20/12/2028 | ITRX EUR CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 | 1,000% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 47 188 |

Enhanced Bond 6M

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 168 000 000 | EUR | 20/12/2028 | 1,000% | ITRX EUR CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (3 213 802) |

Euro Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 9 800 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (763 507) |

Euro Corporate Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 1 000 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (77 909) |

Euro Flexible Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 5 000 000 | EUR | 20/12/2028 | 1,000% | ITRX EUR CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| 10 000 000 | EUR | 20/12/2028 | 1,000% | SNRFIN CDSI S40 5Y Corp 20/12/2028 |
| 41 600 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (3 486 666) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Euro High Yield Short Duration Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 1 000 000 | EUR | 20/12/2028 | TELECOM ITALIA 3% 16-30/09/2025 | 1,000% |
| 2 000 000 | EUR | 20/12/2028 | MARKS & SPENCER 12-12/06/2025 FRN | 1,000% |
| 10 000 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (825 224) |

Euro Short Term Corporate Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 3 500 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (272 681) |

Global Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 25 100 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (1 955 514) |

Global Enhanced Bond 36M

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 300 000 | EUR | 20/12/2028 | 1,000% | ITRX EUR CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| 1 000 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| 5 100 000 | EUR | 20/12/2028 | 5,000% | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (480 983) |

Global High Yield Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|----------------|
| 2 250 000 | USD | 20/12/2028 | CDX HY CDSI S41 5Y PRC CORP 20/12/2028 | 5,000% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 120 995 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Enhanced Bond 12M

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 140 000 000 | EUR | 20/12/2028 | 1,000% | ITRX EUR CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (2 678 169) |

Sustainable Euro Corporate Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------|
| 5 000 000 | EUR | 20/12/2028 | AIR FRANCE-KLM 1,875% 20- 16/01/2025 | 1,000% |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (249 006) |

Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|----------------|
| 48 000 000 | EUR | 20/12/2028 | ITRX EUR CDSI S40 10Y 20/12/2033 | 1,000% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 918 229 |

Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|----------------|
| 3 100 000 | EUR | 20/12/2028 | ITRX EUR CDSI S40 10Y 20/12/2033 | 1,000% |
| 6 800 000 | USD | 20/12/2028 | CDX IG CDSI S41 5Y Corp 20/12/2028 | 1,000% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 200 718 |

Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|----------------|
| 300 000 | EUR | 20/12/2028 | ITRX XOVER CDSI S40 5Y CORP 20/12/2028 | 5,000% |
| 1 900 000 | USD | 20/12/2028 | CDX HY CDSI S41 5Y PRC CORP 20/12/2028 | 5,000% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 138 684 |

Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|------------------|
| 54 000 000 | USD | 20/12/2028 | CDX IG CDSI S41 5Y Corp 20/12/2028 | 1,000% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en USD) | 1 073 724 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

US High Yield Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|---|--------|------------|---|---------------|
| 1 475 000 | USD | 20/12/2028 | CDX HY CDSI S41 5Y PRC CORP 20/12/2028 | 5,000% |
| Plus-value nette non réalisée (en USD) | | | | 87 619 |

Swaps de taux d'intérêt

La Société a conclu des contrats de swap de taux d'intérêt par le biais desquels elle échange des revenus fixes (produit du montant notionnel et du taux fixe) contre des revenus variables (produit du montant notionnel et du taux variable) et inversement. Ces montants sont calculés et constatés à chaque calcul de la Valeur nette d'inventaire. Le montant à recevoir est inclus dans la rubrique « Autres actifs » de l'Etat des actifs nets et le montant à payer est inclus dans la rubrique « Autres passifs » de l'Etat des actifs nets.

Emerging Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|--|--------|------------|------------|------------------|
| 57 060 000 | PLN | 18/12/2025 | 4,754% | IBOR 6M |
| 60 230 000 | PLN | 07/12/2025 | 4,922% | IBOR 6M |
| 214 250 000 | CZK | 07/11/2025 | 4,940% | IBOR 6M |
| 324 840 000 | CZK | 03/11/2025 | 5,005% | IBOR 6M |
| 108 680 000 | CZK | 06/11/2025 | 4,930% | IBOR 6M |
| 90 530 000 | ZAR | 15/11/2028 | 8,204% | IBOR 3M |
| Moins-value nette non réalisée (en USD) | | | | (234 527) |

Enhanced Bond 6M

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|--|--------|------------|------------|------------------------------|
| 150 000 000 | EUR | 16/11/2026 | 3,089% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 200 000 000 | EUR | 07/11/2025 | 3,231% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 90 000 000 | EUR | 07/12/2026 | 2,605% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 40 000 000 | EUR | 19/12/2026 | 2,448% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| Moins-value nette non réalisée (en EUR) | | | | (6 072 429) |

Euro Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------|
| 125 000 000 | CZK | 31/10/2025 | 5,117% | IBOR 6M |
| 32 000 000 | GBP | 11/04/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,202% |
| 110 200 000 | ZAR | 16/11/2028 | 8,100% | IBOR 3M |
| 124 918 366 | CZK | 24/10/2025 | 5,152% | IBOR 6M |
| 8 900 000 | EUR | 01/03/2029 | EURIBOR 6M | 3,012% |
| 2 000 000 | EUR | 01/03/2054 | 2,666% | EURIBOR 6M |
| 30 000 000 | GBP | 15/11/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,733% |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 24 500 000 | GBP | 17/01/2026 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,018% |
| 7 000 000 | GBP | 15/11/2033 | 4,022% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 5 700 000 | GBP | 17/01/2034 | 4,322% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 57 000 000 | MXN | 30/10/2033 | MXN SWAP (TIIE) 1M | 9,605% |
| 2 700 000 | USD | 20/12/2033 | 3,582% | SOFR (SECURED OVERNIGHT FINANCING RATE) |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (54 684) |

Euro Corporate Green Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|----------------|
| 3 000 000 | EUR | 20/06/2025 | EURIBOR 6M | 3,597% |
| 3 000 000 | EUR | 16/05/2025 | EURIBOR 6M | 3,295% |
| 2 000 000 | EUR | 19/09/2025 | EURIBOR 6M | 3,320% |
| 3 000 000 | EUR | 23/01/2026 | EURIBOR 6M | 3,472% |
| 3 000 000 | EUR | 23/01/2026 | EURIBOR 6M | 3,471% |
| 3 500 000 | EUR | 27/03/2026 | EURIBOR 6M | 3,360% |
| 2 000 000 | EUR | 29/05/2026 | EURIBOR 6M | 3,405% |
| 3 000 000 | EUR | 11/09/2026 | EURIBOR 6M | 3,517% |
| 2 000 000 | EUR | 10/09/2027 | EURIBOR 6M | 3,363% |
| 1 000 000 | EUR | 08/09/2028 | EURIBOR 6M | 3,318% |
| 1 000 000 | EUR | 15/12/2028 | EURIBOR 6M | 3,314% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 405 179 |

Euro Flexible Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------------------|
| 25 000 000 | EUR | 16/11/2026 | 3,090% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (518 378) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Euro Government Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 65 214 917 | GBP | 04/10/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,236% |
| 75 000 000 | GBP | 15/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,462% |
| 75 000 000 | GBP | 15/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,609% |
| 15 314 243 | GBP | 04/10/2033 | 4,547% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 15 000 000 | GBP | 15/12/2033 | 3,812% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 19 000 000 | GBP | 15/12/2033 | 3,688% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (414 706) |

Euro Inflation-Linked Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|---|
| 2 100 000 | EUR | 15/06/2053 | 0,000% | 2,735% |
| 4 100 000 | GBP | 04/10/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,228% |
| 960 000 | GBP | 04/10/2033 | 4,531% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 4 100 000 | GBP | 07/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,617% |
| 8 246 000 | GBP | 13/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,456% |
| 8 265 000 | GBP | 13/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,452% |
| 960 000 | GBP | 07/12/2033 | 3,807% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 307 122 |

Euro Money Market

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|------------|------------------------------|
| 9 800 000 | EUR | 12/06/2024 | 3,778% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 10 000 000 | EUR | 22/04/2024 | 3,612% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 24 000 000 | EUR | 22/04/2024 | 3,606% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 9 500 000 | EUR | 23/05/2024 | 3,619% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 14 000 000 | EUR | 24/06/2024 | 3,835% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 9 500 000 | EUR | 24/06/2024 | 3,828% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 6 700 000 | EUR | 30/05/2024 | 3,631% | EURO SHORT-TERM RATE |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|------------|------------------------------|
| 14 000 000 | EUR | 24/10/2024 | 3,829% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 10 000 000 | EUR | 11/04/2024 | 3,389% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 24 000 000 | EUR | 14/11/2024 | 3,747% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 20 000 000 | EUR | 03/01/2024 | 3,083% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 10 000 000 | EUR | 23/01/2024 | 3,098% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 15 000 000 | EUR | 24/01/2024 | 3,104% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 25 000 000 | EUR | 29/01/2024 | 3,097% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 10 000 000 | EUR | 05/02/2024 | 3,235% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 5 000 000 | EUR | 15/02/2024 | 3,330% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 5 000 000 | EUR | 23/02/2024 | 3,604% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 7 500 000 | EUR | 27/02/2024 | 3,465% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 4 500 000 | EUR | 13/03/2024 | 3,018% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 24 000 000 | EUR | 28/03/2024 | 3,271% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 10 000 000 | EUR | 02/04/2024 | 3,457% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 9 000 000 | EUR | 15/04/2024 | 3,501% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 28 500 000 | EUR | 30/04/2024 | 3,553% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 14 000 000 | EUR | 07/05/2024 | 3,443% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 9 500 000 | EUR | 07/05/2024 | 3,525% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 14 400 000 | EUR | 13/05/2024 | 3,474% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 12 500 000 | EUR | 22/05/2024 | 3,577% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 24 000 000 | EUR | 31/05/2024 | 3,548% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 19 000 000 | EUR | 31/05/2024 | 3,548% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 10 000 000 | EUR | 10/06/2024 | 3,637% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 14 500 000 | EUR | 10/06/2024 | 3,762% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 19 000 000 | EUR | 14/06/2024 | 3,659% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 9 000 000 | EUR | 18/06/2024 | 3,753% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 9 500 000 | EUR | 21/06/2024 | 3,812% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 9 500 000 | EUR | 25/06/2024 | 3,802% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 19 000 000 | EUR | 25/06/2024 | 3,801% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 24 000 000 | EUR | 27/06/2024 | 3,800% | EURO SHORT-TERM RATE |
| 24 000 000 | EUR | 03/06/2024 | 3,856% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 24 000 000 | EUR | 11/01/2024 | 3,773% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 26/02/2024 | 3,836% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 14 500 000 | EUR | 02/07/2024 | 3,684% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 000 000 | EUR | 04/07/2024 | 3,865% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 15/07/2024 | 3,854% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 10 000 000 | EUR | 18/07/2024 | 3,826% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 23/07/2024 | 3,854% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 26/07/2024 | 3,808% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 26/07/2024 | 3,807% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------------------|
| 14 400 000 | EUR | 31/07/2024 | 3,792% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 13/08/2024 | 3,784% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 19 000 000 | EUR | 23/08/2024 | 3,768% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 27/08/2024 | 3,762% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 24 000 000 | EUR | 29/08/2024 | 3,800% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 02/09/2024 | 3,741% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 19 000 000 | EUR | 09/09/2024 | 3,778% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 12/09/2024 | 3,797% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 11 400 000 | EUR | 27/09/2024 | 3,909% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 3 500 000 | EUR | 03/10/2024 | 3,893% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 33 500 000 | EUR | 03/10/2024 | 3,900% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 04/10/2024 | 3,900% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 04/10/2024 | 3,902% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 19 000 000 | EUR | 08/10/2024 | 3,858% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 19 000 000 | EUR | 11/10/2024 | 3,824% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 23 500 000 | EUR | 11/10/2024 | 3,835% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 14 000 000 | EUR | 14/10/2024 | 3,839% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 14 300 000 | EUR | 28/10/2024 | 3,833% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 14 000 000 | EUR | 04/11/2024 | 3,689% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 14 500 000 | EUR | 05/11/2024 | 3,721% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 11 500 000 | EUR | 12/11/2024 | 3,732% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 5 700 000 | EUR | 13/11/2024 | 3,738% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 5 800 000 | EUR | 02/12/2024 | 3,563% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 24 000 000 | EUR | 05/12/2024 | 3,387% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 11/12/2024 | 3,428% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| 9 500 000 | EUR | 13/12/2024 | 3,436% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (857 008) |

Flexible Global Credit

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|---|
| 100 000 | EUR | 12/12/2033 | 3,163% | EURIBOR 6M |
| 100 000 | GBP | 12/12/2033 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,040% |
| 100 000 | EUR | 12/12/2033 | 3,115% | EURIBOR 6M |
| 200 000 | USD | 12/12/2033 | 3,983% | SOFR (SECURED OVERNIGHT FINANCING RATE) |
| 200 000 | USD | 12/12/2033 | 3,801% | SOFR (SECURED OVERNIGHT FINANCING RATE) |
| 400 000 | GBP | 12/12/2033 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,330% |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|-----------------------------|
| 500 000 | AUD | 12/12/2033 | AUST BANK BILL 6M | 4,493% |
| 700 000 | CAD | 12/12/2033 | 4,197% | CANADA BANKER ACCEPTANCE 3M |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (699) |

Global Absolute Return Multi-Factor Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|--|
| 300 000 | EUR | 12/12/2033 | 3,163% | EURIBOR 6M |
| 300 000 | EUR | 12/12/2033 | 3,115% | EURIBOR 6M |
| 300 000 | GBP | 12/12/2033 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,040% |
| 500 000 | USD | 12/12/2033 | 3,983% | SOFR (SECURED OVERNIGHT FINANCING RATE) |
| 500 000 | USD | 12/12/2033 | 3,801% | SOFR (SECURED OVERNIGHT FINANCING RATE) |
| 1 100 000 | GBP | 12/12/2033 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,330% |
| 1 700 000 | CAD | 12/12/2033 | 4,197% | CANADA BANKER ACCEPTANCE 3M |
| 1 300 000 | AUD | 12/12/2033 | AUST BANK BILL 6M | 4,493% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 9 306 |

Global Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|--|
| 345 000 000 | CZK | 31/10/2025 | 5,117% | IBOR 6M |
| 87 100 000 | GBP | 11/04/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,202% |
| 11 900 000 | GBP | 23/05/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,744% |
| 295 800 000 | ZAR | 16/11/2028 | 8,100% | IBOR 3M |
| 344 722 807 | CZK | 24/10/2025 | 5,152% | IBOR 6M |
| 25 200 000 | EUR | 01/03/2029 | EURIBOR 6M | 3,012% |
| 5 800 000 | EUR | 01/03/2054 | 2,666% | EURIBOR 6M |
| 35 200 000 | GBP | 30/08/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,575% |
| 40 700 000 | GBP | 15/11/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,733% |
| 68 000 000 | GBP | 17/01/2026 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,018% |
| 18 900 000 | GBP | 15/11/2033 | 4,022% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 15 900 000 | GBP | 17/01/2034 | 4,322% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|---|
| 153 100 000 | MXN | 30/10/2033 | MXN SWAP (TIIE) 1M | 9,690% |
| 7 200 000 | USD | 20/12/2033 | 3,582% | SOFR (SECURED OVERNIGHT FINANCING RATE) |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 270 097 |

Global Enhanced Bond 36M

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|---|
| 155 000 000 | CZK | 31/10/2025 | 5,117% | IBOR 6M |
| 14 900 000 | GBP | 11/04/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,202% |
| 12 000 000 | GBP | 12/06/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,231% |
| 146 200 000 | ZAR | 16/11/2028 | 8,100% | IBOR 3M |
| 155 698 970 | CZK | 24/10/2025 | 5,152% | IBOR 6M |
| 9 500 000 | EUR | 01/03/2029 | EURIBOR 6M | 3,012% |
| 2 200 000 | EUR | 01/03/2054 | 2,666% | EURIBOR 6M |
| 39 400 000 | GBP | 15/11/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,733% |
| 29 900 000 | GBP | 17/01/2026 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,018% |
| 9 100 000 | GBP | 15/11/2033 | 4,022% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 7 000 000 | GBP | 17/01/2034 | 4,322% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 13 200 000 | GBP | 27/11/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,883% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 121 330 |

Global Inflation-Linked Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|---|
| 1 620 000 | EUR | 15/06/2053 | 0,000% | 2,735% |
| 5 456 421 | GBP | 04/10/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,214% |
| 5 456 421 | GBP | 04/10/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 5,211% |
| 1 290 000 | GBP | 04/10/2033 | 4,516% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 1 290 000 | GBP | 04/10/2033 | 4,511% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| 11 237 000 | GBP | 07/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,619% |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|---|
| 22 170 000 | GBP | 13/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,449% |
| 22 198 000 | GBP | 13/12/2025 | SONIA (STERLING INTERBANK AVERAGE RATE) | 4,445% |
| 2 578 000 | GBP | 07/12/2033 | 3,813% | SONIA (STERLING OVERNIGHT INTERBANK AVERAGE RATE) |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 445 070 |

Local Emerging Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------|
| 43 580 000 | PLN | 18/12/2025 | 4,754% | IBOR 6M |
| 44 520 000 | PLN | 07/12/2025 | 4,922% | IBOR 6M |
| 157 840 000 | CZK | 07/11/2025 | 4,940% | IBOR 6M |
| 238 030 000 | CZK | 03/11/2025 | 5,005% | IBOR 6M |
| 79 530 000 | CZK | 06/11/2025 | 4,930% | IBOR 6M |
| 70 100 000 | ZAR | 15/11/2028 | 8,204% | IBOR 3M |
| 23 560 000 | ZAR | 16/11/2028 | 8,120% | IBOR 3M |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en USD) | (176 823) |

Sustainable Enhanced Bond 12M

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------------------|
| 200 000 000 | EUR | 07/11/2025 | 3,231% | ESTER (EURO SHORT-TERM RATE) |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (2 144 140) |

Sustainable Euro Corporate Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|------------|------------|
| 20 000 000 | EUR | 20/06/2025 | EURIBOR 6M | 3,172% |
| 23 000 000 | EUR | 25/04/2025 | EURIBOR 6M | 3,582% |
| 10 000 000 | EUR | 16/05/2025 | EURIBOR 6M | 3,135% |
| 30 000 000 | EUR | 19/09/2025 | EURIBOR 6M | 3,231% |
| 30 000 000 | EUR | 28/11/2025 | EURIBOR 6M | 3,204% |
| 20 000 000 | EUR | 23/01/2026 | EURIBOR 6M | 3,390% |
| 25 000 000 | EUR | 27/03/2026 | EURIBOR 6M | 3,351% |
| 22 000 000 | EUR | 22/05/2026 | EURIBOR 6M | 3,189% |
| 10 000 000 | EUR | 11/06/2027 | EURIBOR 6M | 3,227% |
| 10 000 000 | EUR | 17/12/2027 | EURIBOR 6M | 3,212% |
| 8 000 000 | EUR | 28/04/2028 | EURIBOR 6M | 3,163% |
| 4 000 000 | EUR | 23/06/2028 | EURIBOR 6M | 3,270% |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|------------------|
| 19 000 000 | EUR | 11/09/2026 | EURIBOR 6M | 3,517% |
| 20 000 000 | EUR | 10/09/2027 | EURIBOR 6M | 3,363% |
| 9 000 000 | EUR | 08/09/2028 | EURIBOR 6M | 3,318% |
| 10 000 000 | EUR | 15/12/2028 | EURIBOR 6M | 3,314% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 3 901 414 |

USD Money Market

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|------------|---------------------------------|
| 9 000 000 | USD | 20/06/2024 | 5,240% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 400 000 | USD | 20/06/2024 | 5,251% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 12 000 000 | USD | 04/03/2024 | 5,392% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 4 000 000 | USD | 11/04/2024 | 4,760% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 12 000 000 | USD | 03/01/2024 | 5,344% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 500 000 | USD | 23/01/2024 | 5,421% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 5 000 000 | USD | 24/01/2024 | 4,825% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 14 500 000 | USD | 29/01/2024 | 5,400% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 000 000 | USD | 23/02/2024 | 5,454% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 700 000 | USD | 23/02/2024 | 5,455% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 5 500 000 | USD | 27/02/2024 | 5,433% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 14 500 000 | USD | 30/04/2024 | 5,446% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 5 000 000 | USD | 18/01/2024 | 4,865% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 5 000 000 | USD | 07/02/2024 | 5,052% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 10 000 000 | USD | 08/02/2024 | 5,044% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 15 000 000 | USD | 05/03/2024 | 5,404% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 18 500 000 | USD | 26/04/2024 | 4,728% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---------------------------------|
| 6 500 000 | USD | 03/06/2024 | 5,082% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 6 500 000 | USD | 04/06/2024 | 4,994% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 800 000 | USD | 11/01/2024 | 5,430% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 400 000 | USD | 11/10/2024 | 5,351% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 14 000 000 | USD | 12/11/2024 | 5,320% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 14 000 000 | USD | 16/01/2024 | 5,409% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 500 000 | USD | 16/01/2024 | 5,406% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 800 000 | USD | 16/01/2024 | 5,412% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 700 000 | USD | 14/02/2024 | 5,443% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 700 000 | USD | 22/02/2024 | 5,448% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 4 500 000 | USD | 28/06/2024 | 5,319% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 400 000 | USD | 20/08/2024 | 5,357% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 6 500 000 | USD | 22/08/2024 | 5,402% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 300 000 | USD | 30/08/2024 | 5,406% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 400 000 | USD | 11/09/2024 | 5,419% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| 9 400 000 | USD | 09/10/2024 | 5,446% | FEDERAL FUNDS EFFECTIVE RATE US |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en USD) | (119 243) |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Swaps d'inflation

Le Fonds a conclu des « swaps d'inflation », c'est-à-dire des contrats permettant de recevoir la différence entre un niveau d'inflation, appliqué à un montant nominal convenu à l'entrée en vigueur du contrat, et un taux d'intérêt fixe appliqué au même montant nominal. Ces montants sont calculés et comptabilisés à chaque calcul de la VNI. Le montant à recevoir est inclus dans la rubrique « Autres actifs » de l'Etat des actifs nets et le montant à payer est inclus dans la rubrique « Autres passifs » de l'Etat des actifs nets.

Euro Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------|
| 11 500 000 | EUR | 15/03/2032 | 2,545% | HICPXT 0D |
| 11 500 000 | EUR | 15/03/2042 | HICPXT 0D | 2,465% |
| 7 500 000 | USD | 11/03/2032 | USCPI 0D | 3,100% |
| 7 500 000 | USD | 11/03/2042 | 2,833% | USCPI 0D |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (188 687) |

Euro Government Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------|
| 14 487 440 | EUR | 15/07/2052 | 0,000% | 2,345% |
| 35 101 415 | EUR | 15/02/2033 | 2,295% | 0,000% |
| 34 555 355 | EUR | 15/02/2043 | 0,000% | 2,441% |
| 7 000 000 | EUR | 15/12/2053 | FRANCE CPI EX TOBACCO (CPTFEMU) | 2,530% |
| 14 000 000 | EUR | 15/12/2053 | FRANCE CPI EX TOBACCO (CPTFEMU) | 2,415% |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (722 774) |

Euro Inflation-Linked Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|-----------------------------|
| 420 000 | EUR | 15/03/2052 | HICPXT 0D | 2,540% |
| 420 000 | EUR | 15/03/2052 | HICPXT 0D | 2,560% |
| 600 000 | USD | 17/03/2052 | 2,763% | USCPI 0D |
| 640 000 | USD | 29/03/2052 | 2,690% | USCPI 0D |
| 7 440 000 | EUR | 15/02/2033 | 2,310% | 0,000% |
| 7 440 000 | EUR | 15/02/2043 | 0,000% | 2,445% |
| 1 792 000 | EUR | 15/12/2053 | 0,000% | 2,431% |
| 2 000 000 | EUR | 15/07/2053 | 0,000% | 2,817% |
| 1 974 000 | EUR | 15/11/2053 | FRANCE CPI EX TOBACCO (CPTFEMU) | 2,553% |
| 2 953 000 | USD | 21/11/2053 | 2,599% | 0,000% |
| 2 730 000 | USD | 02/01/2054 | 2,403% | US CPI URBAN CONSUMERS NASA |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 137 265 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Global Bond Opportunities

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|------------------|
| 17 100 000 | EUR | 15/03/2032 | 2,545% | HICPXT 0D |
| 17 100 000 | EUR | 15/03/2042 | HICPXT 0D | 2,465% |
| 13 200 000 | USD | 11/03/2032 | USCPI 0D | 3,100% |
| 13 200 000 | USD | 11/03/2042 | 2,833% | USCPI 0D |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (302 703) |

Global Enhanced Bond 36M

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|---|----------------|
| 500 000 | EUR | 15/03/2032 | 2,545% | HICPXT 0D |
| 500 000 | EUR | 15/03/2042 | HICPXT 0D | 2,465% |
| 700 000 | USD | 11/03/2032 | USCPI 0D | 3,100% |
| 700 000 | USD | 11/03/2042 | 2,833% | USCPI 0D |
| 300 000 | EUR | 15/05/2052 | HICPXT 0D | 2,660% |
| 420 000 | USD | 09/05/2052 | 2,775% | USCPI 0D |
| 1 600 000 | USD | 15/12/2053 | 2,444% | 0,000% |
| 2 600 000 | EUR | 15/08/2053 | 0,000% | 2,809% |
| | | | Plus-value nette non réalisée (en EUR) | 251 993 |

Global Inflation-Linked Bond

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|-----------------------------|
| 1 430 000 | EUR | 15/03/2052 | HICPXT 0D | 2,555% |
| 1 440 000 | EUR | 15/03/2052 | HICPXT 0D | 2,540% |
| 2 080 000 | USD | 17/03/2052 | 2,763% | USCPI 0D |
| 2 200 000 | USD | 29/03/2052 | 2,690% | USCPI 0D |
| 4 560 000 | EUR | 15/02/2033 | 2,310% | 0,000% |
| 4 560 000 | EUR | 15/02/2043 | 0,000% | 2,445% |
| 1 726 000 | EUR | 15/07/2053 | 0,000% | 2,817% |
| 900 000 | EUR | 15/11/2053 | FRANCE CPI EX TOBACCO (CPTFEMU) | 2,553% |
| 890 000 | EUR | 15/11/2053 | FRANCE CPI EX TOBACCO (CPTFEMU) | 2,553% |
| 1 397 000 | USD | 21/11/2053 | 2,599% | US CPI URBAN CONSUMERS NASA |
| 1 331 000 | USD | 21/11/2053 | 2,599% | US CPI URBAN CONSUMERS NASA |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (115 021) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Sustainable Multi-Asset Flexible

| Valeur nominale | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|--------|------------|--|---|
| 1 220 000 | USD | 02/06/2043 | 0,500% | BNP PARIBAS STRATEGY C52 INDEX (BNPIC52P) |
| 700 000 | USD | 21/06/2043 | 0,500% | BNP PARIBAS STRATEGY C52 INDEX (BNPIC52P) |
| 11 000 000 | USD | 06/07/2043 | 0,500% | BNP PARIBAS STRATEGY C52 INDEX (BNPIC52P) |
| | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (129 693) |

Swaps sur rendement total

Un TRS (swap sur rendement total) est un contrat portant sur l'échange de la performance totale d'une obligation ou d'un autre actif sous-jacent (action, indice, etc.) contre le taux d'un indice de référence majoré d'un spread. La performance totale comprend les coupons d'intérêts, les dividendes et les plus- et moins-values sur l'actif sous-jacent pendant toute la durée du contrat, en fonction du type de sous-jacent concerné. Le risque de ce type d'accord réside dans le fait que les bénéfices de chaque contrepartie dépendent de la performance de l'actif sous-jacent dans le temps, laquelle est inconnue au moment de la signature du contrat.

Seasons

| Valeur nominale | % des actifs engagés | Contrepartie | Devise | Echéance | Flux payés | Flux reçus |
|-----------------|----------------------|--|--------|------------|--|------------------------|
| 137 617 865 | 25,55% | JP MORGAN SECURITIES LIMITED, UNITED KINGDOM | EUR | 30/06/2027 | PERFORMANCE OF BASKET SHARES* | EURIBOR 3M +SPREAD |
| 235 000 000 | 43,63% | JP MORGAN, GERMANY | EUR | 05/06/2029 | PERFORMANCE OF BASKET SHARES* | EURIBOR 3M +SPREAD |
| 10 000 000 | 1,86% | JP MORGAN, GERMANY | EUR | 09/10/2024 | PERFORMANCE OF BASKET SHARES* | ESTER CAPI (EUR) RI 3M |
| | | | | | Moins-value nette non réalisée (en EUR) | (39 145 399) |

(*) Le panier d'actions se compose comme suit :

| | | |
|----------------------|------------------------------|----------------------|
| AIR LIQUIDE SA | ENGIE | RANDSTAD HOLDING NV |
| AMUNDI SA | KERING | SANOFI AVENTIS |
| ASM INTERNATIONAL NV | LEGRAND SA | SOCIETE GENERALE SA |
| ATOS SE | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | SODEXO SA |
| AXA SA | MERCEDES BENZ GROUP AG | TOTAL SA |
| BNP PARIBAS | MICHELIN (CGDE) | VALEO SA |
| CAPGEMINI SE | NN GROUP NV - W/I | VEOLIA ENVIRONNEMENT |
| CARREFOUR SA | ORANGE | VINCI SA |
| CREDIT AGRICOLE SA | PERNOD RICARD SA | VIVENDI |
| DANONE | PUBLICIS GROUPE | |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Contreparties aux contrats de swap :

Bank of America Securities Europe, France
 Barclays Bank Ireland Plc, Irlande
 Barclays Bank London, Royaume-Uni
 BNP Paribas Paris, France
 Citigroup Global Market, Allemagne
 Goldman Sachs International, Royaume-Uni
 HSBC France, France
 JP Morgan Chase Bank, Royaume-Uni
 JP Morgan Securities Limited, Royaume-Uni
 JP Morgan, Allemagne
 Merrill Lynch International, Royaume-Uni
 Morgan Stanley Bank AG, Allemagne
 Morgan Stanley Europe SE, Allemagne
 Morgan Stanley International, Royaume-Uni
 Société Générale Paris, France

Veillez noter que tous les TRS sont réglés sur une base bilatérale.

Note 14 - Contracts for Difference (CFD)

Les Contracts for Difference (CFD) sont des contrats financiers de gré à gré utilisés afin de s'exposer aux fluctuations (positives ou négatives selon la direction que prend la transaction) d'instruments financiers, de paniers d'instruments financiers ou d'indices, et ce sans devoir détenir ou emprunter les instruments financiers sous-jacents.

Les plus-values/(moins-values) nettes non réalisées sont nulles du fait des Réinitialisations des CFD effectuées mensuellement. Lors de chaque jour de réinitialisation, les positions existantes sont fermées et rouvertes au cours réinitialisé (correspondant au cours de clôture du sous-jacent le jour de réinitialisation).

Au 31 décembre 2023, les positions suivantes étaient ouvertes :

Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH)

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Nominal (en USD) | Plus/(moins)-value nette non réalisée (en USD) |
|--------|----------|-----------------|-----------------------|---------------------|--|
| USD | 2 000 | V | EXXON MOBIL CORP | 199 960 | 0 |
| USD | 7 465 | V | EXXON MOBIL CORP | 746 351 | 0 |
| USD | 30 268 | V | EQUINOR ASA-SPON ADR | 957 680 | 0 |
| GBP | 168 275 | V | BP PLC | 999 945 | 0 |
| USD | 1 838 | V | LG ENERGY SOLUTION | 610 050 | 0 |
| EUR | 45 095 | V | STOXX 600 BANK (SX7P) | 8 416 109 | 0 |
| GBP | 30 665 | V | SHELL PLC | 1 005 218 | 0 |
| USD | 11 331 | V | DOW INC | 621 392 | 0 |
| EUR | 63 272 | V | ENI SPA | 1 072 724 | 0 |
| USD | 13 396 | V | MSBNRNW | 1 446 524 | (115 164) |
| | | | Total : | | (115 164) |

Global Convertible

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Nominal (en USD) | Plus/(moins)-value nette non réalisée (en USD) |
|--------|-----------|-----------------|---|---------------------|--|
| EUR | 6 000 000 | A | DELIVERY HERO AG 3,25% 23- 21/02/2030 CV | 5 683 425 | (469 063) |
| EUR | 52 323 | V | DELIVERY HERO SE | 1 445 543 | 236 685 |
| EUR | 41 060 | V | KLEPIERRE | 1 119 409 | (71 664) |
| EUR | 4 400 000 | A | SCHNEIDER ELEC 1.97% 23- 27/11/2030 CV | 5 237 195 | 269 988 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Nominal (en USD) | Plus/(moins)-value nette non réalisée (en USD) |
|----------------|-----------|-----------------|--|---------------------|--|
| EUR | 8 636 | V | SCHNEIDER ELECTRIC SE | 1 734 137 | (125 543) |
| EUR | 4 500 000 | A | SIMON GLOBAL DEV 3.5% 23- 14/11/2026 CV | 5 198 395 | 145 504 |
| Total : | | | | | (14 093) |

Courtiers pour les Contracts for difference :

BNP Paribas Paris
 Goldman Sachs & Co.
 Goldman Sachs International London
 Morgan Stanley London Derivatives

Note 15 - Positions sur options

S'agissant des contrats d'option avec la même Description, Devise, Echéance, Contrepartie et le même Prix d'exercice, les positions sont combinées. Dans ce contexte, les quantités d'options peuvent être égales à 0.

Au 31 décembre 2023, les positions sur options suivantes étaient ouvertes :

Euro Bond Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|------------|-----------------|-----------------------------------|---------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 8 790 000 | V | PUT EUR/JPY 04/03/2024 153,5 | 04/03/2024 | 153,500 | 8 663 933 | 117 303 |
| EUR | 8 790 000 | A | PUT JPY/EUR 04/03/2024 149 | 04/03/2024 | 149,000 | 8 409 941 | (49 567) |
| EUR | 3 580 000 | A | PUT EUR/JPY 05/01/2024 154 | 05/01/2024 | 154,000 | 3 540 149 | 4 171 |
| EUR | 7 190 000 | V | PUT USD/EUR 18/01/2024 1,075 | 18/01/2024 | 1,075 | 6 997 013 | (2 545) |
| EUR | 3 600 000 | A | PUT EUR/USD 18/01/2024 1,085 | 18/01/2024 | 1,085 | 3 535 962 | 4 100 |
| EUR | 3 630 000 | A | PUT EUR/USD 12/01/2024 1,105 | 12/01/2024 | 1,105 | 3 631 150 | 12 309 |
| USD | 9 170 000 | V | PUT JPY/USD 05/08/2024 131 | 05/08/2024 | 131,000 | 8 096 361 | (125 358) |
| USD | 9 170 000 | A | PUT USD/JPY 05/08/2024 137,5 | 05/08/2024 | 137,500 | 7 713 624 | 275 635 |
| USD | 3 724 000 | V | PUT JPY/USD 09/02/2024 140 | 09/02/2024 | 140,000 | 3 347 769 | (46 620) |
| USD | 1 862 000 | A | PUT USD/JPY 09/02/2024 145 | 09/02/2024 | 145,000 | 1 733 666 | 63 045 |
| USD | 7 600 000 | A | PUT USD/JPY 20/02/2024 143 | 20/02/2024 | 143,000 | 6 978 586 | 195 702 |
| USD | 22 880 000 | V | PUT JPY/USD 26/06/2024 134 | 26/06/2024 | 134,000 | 20 274 629 | (367 149) |
| USD | 22 880 000 | A | PUT USD/JPY 26/06/2024 138 | 26/06/2024 | 138,000 | 19 686 959 | 619 219 |
| USD | 6 620 000 | A | PUT USD/JPY 03/10/2024 130 | 03/10/2024 | 130,000 | 5 526 105 | 104 941 |
| USD | 7 600 000 | V | PUT JPY/USD 20/02/2024 143 | 20/02/2024 | 143,000 | 6 978 586 | (195 702) |
| GBP | 7 570 000 | A | PUT GBP/AUD 09/02/2024 1,8775 | 09/02/2024 | 1,878 | 8 603 867 | 110 324 |
| GBP | 7 570 000 | V | PUT AUD/GBP 09/02/2024 1,84 | 09/02/2024 | 1,840 | 8 779 217 | (35 485) |
| AUD | 17 400 000 | V | CALL AUD/USD 18/01/2024 0,6775 | 18/01/2024 | 0,678 | 10 671 706 | (141 423) |
| AUD | 11 600 000 | A | CALL USD/AUD 18/01/2024 0,665 | 18/01/2024 | 0,665 | 6 983 207 | 196 438 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|-----------|-----------------|---------------------------------|---------------------|--------|---------------------|------------------------------|
| AUD | 5 816 000 | V | PUT USD/AUD 04/01/2024 0,635 | 04/01/2024 | 0,635 | 3 422 260 | 0 |
| AUD | 5 816 000 | A | PUT AUD/USD 04/01/2024 0,65 | 04/01/2024 | 0,650 | 3 343 285 | 0 |
| | | | | | | Total : | 739 338 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 2 238 854.

Euro Defensive Equity

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 325 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 35 | 19/01/2024 | 3 500,000 | 11 375 000 | 1 300 |
| EUR | 325 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 25 | 19/01/2024 | 2 500,000 | 8 125 000 | (325) |
| EUR | 385 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 21/06/2024 37 | 21/06/2024 | 3 700,000 | 14 245 000 | 112 420 |
| EUR | 325 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 16/02/2024 26 | 16/02/2024 | 2 600,000 | 8 450 000 | (650) |
| EUR | 325 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 16/02/2024 36 | 16/02/2024 | 3 600,000 | 11 700 000 | 7 150 |
| EUR | 350 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 25 | 15/03/2024 | 2 500,000 | 8 750 000 | (1 400) |
| EUR | 310 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 35 | 15/03/2024 | 3 500,000 | 10 850 000 | 13 020 |
| EUR | 40 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 36 | 15/03/2024 | 3 600,000 | 1 440 000 | 2 080 |
| EUR | 385 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/04/2024 26 | 19/04/2024 | 2 650,000 | 10 202 500 | (6 930) |
| EUR | 385 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/04/2024 37 | 19/04/2024 | 3 700,000 | 14 245 000 | 50 435 |
| EUR | 400 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 17/05/2024 37 | 17/05/2024 | 3 700,000 | 14 800 000 | 83 200 |
| EUR | 400 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 17/05/2024 26 | 17/05/2024 | 2 600,000 | 10 400 000 | (9 600) |
| EUR | 385 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 21/06/2024 26 | 21/06/2024 | 2 600,000 | 10 010 000 | (15 015) |
| EUR | 340 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/07/2024 26 | 19/07/2024 | 2 600,000 | 8 840 000 | (17 680) |
| EUR | 340 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/07/2024 37 | 19/07/2024 | 3 750,000 | 12 750 000 | 130 900 |
| EUR | 80 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 37 | 19/01/2024 | 3 700,000 | 2 960 000 | 560 |
| EUR | 80 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 26 | 19/01/2024 | 2 650,000 | 2 120 000 | (80) |
| EUR | 60 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 16/02/2024 38 | 16/02/2024 | 3 800,000 | 2 280 000 | 2 160 |
| EUR | 60 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 16/02/2024 27 | 16/02/2024 | 2 700,000 | 1 620 000 | (120) |
| EUR | 373 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 16/08/2024 37 | 16/08/2024 | 3 700,000 | 13 801 000 | 163 001 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 373 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 16/08/2024 26 | 16/08/2024 | 2 600,000 | 9 698 000 | (22 007) |
| EUR | 374 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 20/09/2024 26 | 20/09/2024 | 2 600,000 | 9 724 000 | (31 042) |
| EUR | 374 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 20/09/2024 36 | 20/09/2024 | 3 600,000 | 13 464 000 | 163 812 |
| EUR | 364 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 20/12/2024 38 | 20/12/2024 | 3 850,000 | 14 014 000 | 359 268 |
| EUR | 372 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 18/10/2024 25 | 18/10/2024 | 2 500,000 | 9 300 000 | (31 248) |
| EUR | 372 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 18/10/2024 35 | 18/10/2024 | 3 500,000 | 13 020 000 | 159 216 |
| EUR | 4 365 | V | CALL EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 4 | 19/01/2024 | 4 675,000 | 204 063 750 | (218 250) |
| EUR | 367 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/11/2024 36 | 15/11/2024 | 3 600,000 | 13 212 000 | 211 025 |
| EUR | 367 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/11/2024 25 | 15/11/2024 | 2 500,000 | 9 175 000 | (36 700) |
| EUR | 364 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 20/12/2024 27 | 20/12/2024 | 2 700,000 | 9 828 000 | (63 700) |
| | | | | | | Total : | 1 004 800 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 5 594 195.

Euro High Yield Bond

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 1 | A | CALL EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 4 | 19/01/2024 | 4 325,000 | 43 250 | 2 032 |
| | | | | | | Total : | 2 032 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 0.

Europe Convertible

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|------------------------------------|---------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| CHF | 40 | A | CALL SWISS RE AG 15/03/2024 100 | 15/03/2024 | 100,000 | 430 246 | 5 163 |
| | | | | | | Total : | 5 163 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 9 133.

Global Bond Opportunities

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|------------|-----------------|---------------------------------|---------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 17 650 000 | A | PUT EUR/JPY 04/03/2024 153,5 | 04/03/2024 | 153,500 | 16 886 856 | 235 539 |
| EUR | 17 650 000 | V | PUT JPY/EUR 04/03/2024 149 | 04/03/2024 | 149,000 | 17 396 861 | (99 528) |
| EUR | 7 140 000 | A | PUT EUR/JPY 05/01/2024 154 | 05/01/2024 | 154,000 | 7 060 521 | 8 318 |
| EUR | 15 000 000 | V | PUT USD/EUR 18/01/2024 1,075 | 18/01/2024 | 1,075 | 14 597 384 | (5 310) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|------------|-----------------|-----------------------------------|---------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 7 500 000 | A | PUT EUR/USD 18/01/2024 1,085 | 18/01/2024 | 1,085 | 7 366 587 | 8 543 |
| USD | 18 950 000 | V | PUT JPY/USD 05/08/2024 131 | 05/08/2024 | 131,000 | 16 731 302 | (259 054) |
| USD | 18 950 000 | A | PUT USD/JPY 05/08/2024 137,5 | 05/08/2024 | 137,500 | 15 940 367 | 569 606 |
| USD | 7 497 000 | V | PUT JPY/USD 09/02/2024 140 | 09/02/2024 | 140,000 | 6 739 588 | (93 854) |
| USD | 3 748 000 | A | PUT USD/JPY 09/02/2024 145 | 09/02/2024 | 145,000 | 3 489 678 | 126 902 |
| USD | 15 310 000 | A | PUT USD/JPY 20/02/2024 143 | 20/02/2024 | 143,000 | 14 058 178 | 394 236 |
| USD | 61 500 000 | V | PUT JPY/USD 26/06/2024 134 | 26/06/2024 | 134,000 | 54 496 928 | (986 873) |
| USD | 61 500 000 | A | PUT USD/JPY 26/06/2024 138 | 26/06/2024 | 138,000 | 52 917 307 | 1 664 422 |
| USD | 17 790 000 | A | PUT USD/JPY 03/10/2024 130 | 03/10/2024 | 130,000 | 14 850 365 | 282 009 |
| USD | 15 310 000 | V | PUT JPY/USD 20/02/2024 143 | 20/02/2024 | 143,000 | 14 058 178 | (394 236) |
| GBP | 15 280 000 | A | PUT GBP/AUD 09/02/2024 1,8775 | 09/02/2024 | 1,878 | 17 366 854 | 222 689 |
| GBP | 15 280 000 | V | PUT AUD/GBP 09/02/2024 1,84 | 09/02/2024 | 1,840 | 17 720 798 | (71 626) |
| AUD | 35 050 000 | V | CALL AUD/USD 18/01/2024 0,6775 | 18/01/2024 | 0,678 | 21 496 741 | (284 877) |
| AUD | 23 370 000 | A | CALL USD/AUD 18/01/2024 0,665 | 18/01/2024 | 0,665 | 14 068 755 | 395 755 |
| AUD | 11 585 000 | V | PUT USD/AUD 04/01/2024 0,635 | 04/01/2024 | 0,635 | 6 816 865 | 0 |
| AUD | 11 585 000 | A | PUT AUD/USD 04/01/2024 0,65 | 04/01/2024 | 0,650 | 6 659 553 | 0 |
| | | | | | | Total : | 1 712 661 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 5 258 699.

Global Convertible

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en USD) | Valeur de marché (en USD) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| USD | 400 | V | PUT RUSSELL 2000 INDEX 15/03/2024 1650 | 15/03/2024 | 1 650,000 | 66 000 000 | (222 000) |
| USD | 400 | A | PUT RUSSELL 2000 INDEX 15/03/2024 1700 | 15/03/2024 | 1 700,000 | 68 000 000 | 292 000 |
| | | | | | | Total : | 70 000 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à USD 567 920.

Global Enhanced Bond 36M

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|-----------|-----------------|---------------------------------|---------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 7 360 000 | A | PUT EUR/JPY 04/03/2024 153,5 | 04/03/2024 | 153,500 | 7 041 771 | 98 219 |
| EUR | 7 360 000 | V | PUT JPY/EUR 04/03/2024 149 | 04/03/2024 | 149,000 | 7 254 442 | (41 503) |
| EUR | 3 150 000 | A | PUT EUR/JPY 05/01/2024 154 | 05/01/2024 | 154,000 | 3 114 936 | 3 670 |
| EUR | 7 120 000 | V | PUT USD/EUR 18/01/2024 1,075 | 18/01/2024 | 1,075 | 6 928 892 | (2 520) |
| EUR | 3 560 000 | A | PUT EUR/USD 18/01/2024 1,085 | 18/01/2024 | 1,085 | 3 496 673 | 4 055 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|------------|-----------------|---|---------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 3 210 000 | A | PUT EUR/USD 12/01/2024 1,105 | 12/01/2024 | 1,105 | 3 211 017 | 10 885 |
| USD | 7 010 000 | V | PUT JPY/USD 05/08/2024 131 | 05/08/2024 | 131,000 | 6 189 257 | (95 829) |
| USD | 7 010 000 | A | PUT USD/JPY 05/08/2024 137,5 | 05/08/2024 | 137,500 | 5 896 674 | 210 709 |
| USD | 2 896 000 | V | PUT JPY/USD 09/02/2024 140 | 09/02/2024 | 140,000 | 2 603 421 | (36 255) |
| USD | 1 448 000 | A | PUT USD/JPY 09/02/2024 145 | 09/02/2024 | 145,000 | 1 348 200 | 49 027 |
| USD | 6 080 000 | A | PUT USD/JPY 20/02/2024 143 | 20/02/2024 | 143,000 | 5 582 869 | 156 561 |
| USD | 31 580 000 | V | PUT JPY/USD 26/06/2024 134 | 26/06/2024 | 134,000 | 27 983 951 | (506 755) |
| USD | 31 580 000 | A | PUT USD/JPY 26/06/2024 138 | 26/06/2024 | 138,000 | 27 172 822 | 854 674 |
| USD | 9 130 000 | A | PUT USD/JPY 03/10/2024 130 | 03/10/2024 | 130,000 | 5 496 266 | 144 729 |
| USD | 40 | A | CALL US 10YR NOTE FUT (CBT) 26/01/2024 1 | 26/01/2024 | 113,500 | 4 109 899 | 23 763 |
| USD | 6 080 000 | V | PUT JPY/USD 20/02/2024 143 | 20/02/2024 | 143,000 | 5 582 869 | (156 561) |
| GBP | 5 840 000 | A | PUT GBP/AUD 09/02/2024 1,8775 | 09/02/2024 | 1,878 | 6 637 593 | 85 111 |
| GBP | 5 840 000 | V | PUT AUD/GBP 09/02/2024 1,84 | 09/02/2024 | 1,840 | 6 772 870 | (27 375) |
| AUD | 13 700 000 | V | CALL AUD/USD 18/01/2024 0,6775 | 18/01/2024 | 0,678 | 8 402 435 | (111 350) |
| AUD | 9 130 000 | A | CALL USD/AUD 18/01/2024 0,665 | 18/01/2024 | 0,665 | 5 496 266 | 154 611 |
| AUD | 5 023 000 | V | PUT USD/AUD 04/01/2024 0,635 | 04/01/2024 | 0,635 | 2 955 642 | 0 |
| AUD | 5 023 000 | A | PUT AUD/USD 04/01/2024 0,65 | 04/01/2024 | 0,650 | 2 887 435 | 0 |
| | | | | | | Total : | 817 866 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 6 148 700.

Multi-Asset Thematic

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 32 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 39 | 15/03/2024 | 3 950,000 | 1 264 000 | (3 936) |
| EUR | 32 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 41 | 15/03/2024 | 4 100,000 | 1 312 000 | 6 240 |
| EUR | 64 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 41 | 15/03/2024 | 4 150,000 | 2 656 000 | 14 784 |
| EUR | 20 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 21/06/2024 39 | 21/06/2024 | 3 950,000 | 790 000 | 9 900 |
| EUR | 24 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/04/2024 38 | 19/04/2024 | 3 850,000 | 924 000 | 4 416 |
| USD | 4 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 15/03/2024 410 | 15/03/2024 | 4 100,000 | 742 317 | 1 675 |
| USD | 8 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 21/06/2024 415 | 21/06/2024 | 4 150,000 | 1 502 738 | 13 759 |
| USD | 6 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 21/06/2024 400 | 21/06/2024 | 4 000,000 | 1 086 317 | 7 876 |
| USD | 14 | V | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 15/03/2024 425 | 15/03/2024 | 4 250,000 | 2 693 161 | (8 872) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| USD | 28 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 15/03/2024 445 | 15/03/2024 | 4 450,000 | 5 639 796 | 32 952 |
| USD | 5 | A | PUT US 10YR NOTE FUT (CBT) 23/02/2024 11 | 23/02/2024 | 110,000 | 497 895 | 1 556 |
| USD | 5 | V | PUT US 10YR NOTE FUT (CBT) 23/02/2024 10 | 23/02/2024 | 108,500 | 491 106 | (707) |
| | | | | | | Total : | 79 643 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 803 469.

Seasons

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 2 000 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 37 | 19/01/2024 | 3 700,000 | 74 000 000 | (14 000) |
| EUR | 2 000 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/01/2024 38 | 19/01/2024 | 3 850,000 | 77 000 000 | 22 000 |
| EUR | 4 900 | A | CALL EURO STOXX 50 - OPTION 21/06/2024 3 | 21/06/2024 | 3 900,000 | 191 100 000 | 30 360 400 |
| EUR | 22 000 | A | CALL EUR STX 50 ESG (EUR)P 21/06/2024 16 | 21/06/2024 | 162,000 | 356 400 000 | 56 650 000 |
| | | | | | | Total : | 87 018 400 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 0.

Sustainable Multi-Asset Flexible

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|---------|---------------------|------------------------------|
| USD | 3 | A | PUT US 10YR NOTE FUT (CBT) 23/02/2024 11 | 23/02/2024 | 110,000 | 298 737 | 933 |
| USD | 3 | V | PUT US 10YR NOTE FUT (CBT) 23/02/2024 10 | 23/02/2024 | 108,500 | 294 663 | (424) |
| | | | | | | Total : | 509 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR 212 437.

Target Risk Balanced

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| EUR | 112 | V | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 39 | 15/03/2024 | 3 950,000 | 4 424 000 | (13 776) |
| EUR | 120 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 41 | 15/03/2024 | 4 100,000 | 4 920 000 | 23 400 |
| EUR | 224 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 15/03/2024 41 | 15/03/2024 | 4 150,000 | 9 296 000 | 51 744 |
| EUR | 72 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 21/06/2024 39 | 21/06/2024 | 3 950,000 | 2 844 000 | 35 640 |
| EUR | 84 | A | PUT EURO STOXX 50 - OPTION 19/04/2024 38 | 19/04/2024 | 3 850,000 | 3 234 000 | 15 456 |
| USD | 24 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 15/03/2024 410 | 15/03/2024 | 4 100,000 | 4 453 899 | 10 048 |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Devise | Quantité | Achat/ Vente | Description | Date de maturité | Strike | Nominal (en EUR) | Valeur de marché (en EUR) |
|--------|----------|-----------------|---|---------------------|-----------|---------------------|------------------------------|
| USD | 28 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 21/06/2024 415 | 21/06/2024 | 4 150,000 | 5 259 584 | 48 161 |
| USD | 24 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 21/06/2024 400 | 21/06/2024 | 4 000,000 | 4 345 268 | 31 504 |
| USD | 52 | V | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 15/03/2024 425 | 15/03/2024 | 4 250,000 | 10 003 168 | (32 952) |
| USD | 104 | A | PUT S&P 500 E-MINI FUTURE 15/03/2024 445 | 15/03/2024 | 4 450,000 | 20 947 811 | 122 391 |
| | | | | | | Total : | 291 616 |

Au 31 décembre 2023, l'appel de marge lié aux contrats futures et/ou options s'élevait à EUR (341 696).

Contreparties aux options :

Bank of America Securities Europe
 Barclays Bank Ireland Plc
 BNP Paribas, France
 Goldman Sachs International London
 JP Morgan
 Morgan Stanley Bank AG

Swaptions

Option conclue entre deux parties pouvant être exercée sur un swap qui confère à l'acheteur du swap le droit, mais non l'obligation, de recevoir un taux d'intérêt fixe convenu. L'acheteur paie une prime pour le droit d'exercer le swap à ce taux fixe. Appellation abrégée de « call swap option », un call swaption peut être utilisé comme couverture afin de se prémunir contre le risque provenant d'un émetteur d'obligations qui jugerait probable une diminution des taux d'intérêt.

Euro Bond Opportunities

| Valeur nominale | Achat/ Vente | Devise | Désignation | Strike | Echéance | Flux |
|--------------------------------------|-----------------|--------|------------------------|--------|------------|--|
| 29 800 000 | A | EUR | Swaption Put on CDS | 4,750% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 21/02/2024 4,750 |
| 29 800 000 | V | EUR | Swaption Put on CDS | 5,125% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 21/02/2024 5,125 |
| 29 800 000 | V | EUR | Swaption Put on CDS | 7,000% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 5Y 21/02/2024 7,000 |
| Valeur de marché (en EUR) | | | | | | (3 127) |

Global Bond Opportunities

| Valeur nominale | Achat/ Vente | Devise | Désignation | Strike | Echéance | Flux |
|--------------------------------------|-----------------|--------|------------------------|--------|------------|--|
| 89 500 000 | V | EUR | Swaption Put on CDS | 5,125% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 21/02/2024 5,125 |
| 89 500 000 | V | EUR | Swaption Put on CDS | 7,000% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 5Y 21/02/2024 7,000 |
| 89 500 000 | A | EUR | Swaption Put on CDS | 4,750% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 21/02/2024 4,750 |
| Valeur de marché (en EUR) | | | | | | (9 397) |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Global Enhanced Bond 36M

| Valeur nominale | Achat/ Vente | Devise | Désignation | Strike | Echéance | Flux |
|--------------------------------------|--------------|--------|---------------------|--------|------------|--|
| 51 000 000 | A | EUR | Swaption Put on CDS | 4,750% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 21/02/2024 4,750 |
| 51 000 000 | V | EUR | Swaption Put on CDS | 5,125% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 21/02/2024 5,125 |
| 51 000 000 | V | EUR | Swaption Put on CDS | 7,000% | 21/02/2024 | ITRX XOVER CDSI S40 5Y 21/02/2024 7,000 |
| Valeur de marché (en EUR) | | | | | | (5 355) |

Contrepartie aux swaptions :

Morgan Stanley Bank AG, Luxembourg

Note 16 - Prêt de titres

Les revenus des prêts de titres générés par le Fonds au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 sont repris dans l'« Etat des opérations et des changements des actifs nets » au compte « Revenus sur titres et avoirs, nets » comme suit :

| Compartiment | Devise | Bénéfice Net | Coûts et commissions directs et indirects | Bénéfice brut |
|-------------------------------|--------|--------------|---|---------------|
| Belgium Equity | EUR | 349 | 149 | 498 |
| Enhanced Bond 6M | EUR | 9 584 | 4 108 | 13 692 |
| Euro Bond | EUR | 12 930 | 5 541 | 18 471 |
| Euro Equity | EUR | 9 696 | 4 156 | 13 852 |
| Euro Government Bond | EUR | 45 510 | 19 504 | 65 014 |
| Euro Medium Term Bond | EUR | 3 069 | 1 315 | 4 384 |
| Europe Convertible | EUR | 4 314 | 1 849 | 6 163 |
| Europe Equity | EUR | 8 303 | 3 558 | 11 861 |
| Europe Growth | EUR | 931 | 399 | 1 330 |
| Europe Real Estate Securities | EUR | 26 | 11 | 37 |
| Europe Small Cap Convertible | EUR | 13 | 6 | 19 |
| Global Convertible | USD | 30 954 | 13 266 | 44 220 |
| Inclusive Growth | EUR | 1 539 | 660 | 2 199 |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | EUR | 37 175 | 15 932 | 53 107 |
| Sustainable Euro Bond | EUR | 12 620 | 5 408 | 18 028 |
| Sustainable Europe Dividend | EUR | 769 | 329 | 1 098 |
| Sustainable Europe Value | EUR | 242 | 104 | 346 |
| Sustainable Global Equity | USD | 1 050 | 450 | 1 500 |

Les seules commissions restantes imputables aux prêts de titres sont :

- La commission versée à l'Agence (BNPP SA) en rémunération de ses services, qui s'élève à 15% ;
- la commission de la Société de Gestion (BNP Paribas Asset Management), destinée à couvrir ses frais opérationnels, qui s'élève à 15%.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Au 31 décembre 2023, les compartiments ne présentent aucun prêt de titres.

Note 17 - Vue d'ensemble des garanties

Afin de limiter le risque de contrepartie sur les contrats à terme négociés en bourse et les accords de swap, la Société a mis en place un processus de garantie.

Au 31 décembre 2023, la Société avait constitué les garanties suivantes au profit des contreparties aux contrats à terme négociés en bourse et aux accords de swap :

| Compartiment | Devise | Garantie aux opérations de gré à gré | Type de garantie |
|---|--------|--------------------------------------|------------------|
| Aqua | EUR | 2 590 000 | Cash |
| China A-Shares | USD | 131 537 | Cash |
| China Equity | USD | 37 021 | Cash |
| Disruptive Technology | EUR | 2 660 000 | Cash |
| Emerging Bond | USD | 9 808 585 | Cash |
| Emerging Bond Opportunities | USD | 9 912 540 | Cash |
| Energy Transition | EUR | 9 880 000 | Cash |
| Enhanced Bond 6M | EUR | 20 845 061 | Cash |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | USD | 394 852 | Cash |
| Euro Bond Opportunities | EUR | 6 381 620 | Cash |
| Euro Corporate Bond Opportunities | EUR | 199 159 | Cash |
| Euro Flexible Bond | EUR | 7 120 007 | Cash |
| Euro Government Bond | EUR | 8 418 104 | Cash |
| Euro High Yield Bond | EUR | 1 461 441 | Cash |
| Euro High Yield Short Duration Bond | EUR | 2 326 507 | Cash |
| Euro Inflation-Linked Bond | EUR | 1 036 202 | Cash |
| Euro Money Market | EUR | 100 397 | Cash |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | EUR | 692 786 | Cash |
| Flexible Global Credit | EUR | 281 203 | Cash |
| Global Absolute Return Multi-Factor Bond | EUR | 272 952 | Cash |
| Global Bond Opportunities | EUR | 16 688 120 | Cash |
| Global Convertible | USD | 4 335 248 | Cash |
| Global Enhanced Bond 36M | EUR | 4 660 708 | Cash |
| Global High Yield Bond | EUR | 235 000 | Cash |
| Global Inflation-Linked Bond | EUR | 1 249 264 | Cash |
| Green Bond | EUR | 270 000 | Cash |
| Japan Equity | JPY | 365 973 843 | Cash |
| Japan Small Cap | JPY | 492 118 018 | Cash |
| Local Emerging Bond | USD | 1 209 860 | Cash |
| Multi-Asset Thematic | EUR | 150 493 | Cash |
| Nordic Small Cap | EUR | 30 000 | Cash |
| RMB Bond | USD | 15 186 | Cash |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Devise | Garantie aux opérations de gré à gré | Type de garantie |
|---|--------|--------------------------------------|------------------|
| Seasons | EUR | 41 490 000 | Cash |
| SMaRT Food | EUR | 1 050 000 | Cash |
| Sustainable Enhanced Bond 12M | EUR | 10 200 794 | Cash |
| Sustainable Euro Corporate Bond | EUR | 420 000 | Cash |
| Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond | EUR | 1 833 775 | Cash |
| Sustainable Global Corporate Bond | USD | 7 609 802 | Cash |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | USD | 376 030 | Cash |
| Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond | USD | 382 524 | Cash |
| Sustainable Multi-Asset Flexible | EUR | 1 096 543 | Cash |
| Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | USD | 2 429 701 | Cash |
| US High Yield Bond | USD | 198 837 | Cash |
| US Small Cap | USD | 1 | Cash |

Au 31 décembre 2023, les contreparties aux accords de swap avaient constitué les garanties suivantes au profit de la Société :

| Compartiment | Devise | Garantie aux opérations de gré à gré | Type de garantie |
|-------------------------------------|--------|--------------------------------------|------------------|
| Aqua | EUR | 660 000 | Cash |
| Climate Impact | EUR | 1 100 000 | Cash |
| Consumer Innovators | EUR | 630 000 | Cash |
| Disruptive Technology | EUR | 11 790 000 | Cash |
| Ecosystem Restoration | EUR | 1 650 000 | Cash |
| Energy Transition | EUR | 42 180 000 | Cash |
| Euro Bond Opportunities | EUR | 1 850 000 | Cash |
| Euro High Yield Bond | EUR | 550 000 | Cash |
| Euro High Yield Short Duration Bond | EUR | 1 060 000 | Cash |
| Euro Money Market | EUR | 610 000 | Cash |
| Global Bond Opportunities | EUR | 12 070 000 | Cash |
| Global Convertible | USD | 5 777 320 | Cash |
| Global Enhanced Bond 36M | EUR | 2 680 000 | Cash |
| Global Environment | EUR | 2 990 000 | Cash |
| Global High Yield Bond | EUR | 2 110 000 | Cash |
| Global Inflation-Linked Bond | EUR | 7 450 000 | Cash |
| Green Bond | EUR | 8 670 000 | Cash |
| Health Care Innovators | EUR | 2 170 000 | Cash |
| Local Emerging Bond | USD | 1 143 744 | Cash |
| Nordic Small Cap | EUR | 1 130 000 | Cash |
| SMaRT Food | EUR | 1 050 000 | Cash |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Devise | Garantie aux opérations de gré à gré | Type de garantie |
|--|--------|--------------------------------------|------------------|
| Social Bond | EUR | 260 000 | Cash |
| Sustainable Euro Corporate Bond | EUR | 270 000 | Cash |
| Sustainable Europe Value | EUR | 280 000 | Cash |
| Sustainable Global Corporate Bond | USD | 2 198 254 | Cash |
| Sustainable Global Equity | USD | 660 000 | Cash |
| Sustainable Global Low Vol Equity | EUR | 290 000 | Cash |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | USD | 353 488 | Cash |
| Sustainable US Multi-Factor Equity | USD | 1 358 720 | Cash |
| Sustainable US Value Multi-Factor Equity | USD | 552 325 | Cash |
| US Growth | USD | 4 440 694 | Cash |
| US Small Cap | USD | 1 106 000 | Cash |
| USD Short Duration Bond | USD | 320 349 | Cash |

Note 18 - Transactions avec des parties liées

Les parties liées, en leur qualité de gestionnaires de portefeuille, peuvent également effectuer des transactions ou investir dans des devises ou autres produits financiers pour le compte de chaque compartiment au titre duquel elles agissent en tant que courtier, pour leur propre compte ou en tant que contrepartie pour le compte de leurs clients, y compris lorsque les parties liées ou leurs clients ont la possibilité d'effectuer des transactions pour leur compte et pour le compte de chaque compartiment simultanément.

Lors du traitement des achats et des ventes de titres pour chaque compartiment, les parties liées peuvent également agir en tant que contrepartie dans les meilleures conditions de marché.

La Société considère que les commissions, surcoûts et réductions appliquées par les parties liées sont compétitifs même s'il est dans l'intérêt des parties liées d'obtenir des taux avantageux pour chaque compartiment.

Note 19 - Changement dans la composition du portefeuille-titres

La liste des mouvements intervenus dans la composition du portefeuille-titres au cours de l'exercice est disponible gratuitement au siège social de la Société de Gestion et auprès des agents locaux.

Note 20 - Liste des Gestionnaires financiers

- Alfred Berg Kapitalförvaltning AS, Norvège, en abrégé Alfred Berg AS, Norvège
- Alfred Berg Kapitalförvaltning AS, succursale de Suède, en abrégé Alfred Berg AS, Suède
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Asia Limited, Hong Kong, en abrégé BNPP AM Asia
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Brasil Ltda, Sao Paulo - SP, Brésil, en abrégé BNPP AM Brazil
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Paris, en abrégé BNPP AM France
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Succursale de Belgique, Bruxelles, en abrégé BNPP AM BE
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Succursale des Pays-Bas, Amsterdam, en abrégé BNPP AM Nederland
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Singapore Limited, Singapour, en abrégé BNPP AM Singapore
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT UK Limited, Londres, en abrégé BNPP AM UK
- BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT USA Inc., New York, en abrégé BNPP AM USA
- Impax Asset Management Limited Plc., Londres, en abrégé Impax
- Mitsubishi UFJ Kokusai Asset Management Co. Ltd, Tokyo, Japon, en abrégé MUKAM
- Sumitomo Mitsui Asset Management Co. Ltd., Tokyo, Japon, en abrégé Sumitomo
- TEB Portföy Yönetimi A.Ş., Istanbul, Turquie, en abrégé TEB

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Gestionnaires financiers |
|---|--|
| Nordic Small Cap | Alfred Berg AS, Suède BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Europe Emerging Equity (liquidé le 3 juillet 2023) | Alfred Berg AS, Suède qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises |
| Russia Equity | Alfred Berg AS, Suède qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Asia Tech Innovators | BNPP AM Asia qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Sustainable Asia ex-Japan Equity | BNPP AM Asia BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Sustainable Multi-Asset Stability | BNPP AM BE Gestionnaire(s) supplémentaires dans les poches IDR : BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Sustainable Multi-Asset Balanced | BNPP AM BE BNPP AM UK (gestion des devises) Gestionnaire supplémentaire dans les poches IDR : BNPP AM France |
| Sustainable Multi-Asset Growth | BNPP AM BE BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Brazil Equity | BNPP AM Brazil |
| Latin America Equity | BNPP AM Brazil qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises |
| Euro Bond Euro Flexible Bond Euro Money Market Sustainable Euro Low Vol Equity Sustainable Euro Multi-Factor Equity Sustainable Japan Multi-Factor Equity USD Money Market | BNPP AM France |
| Belgium Equity Euro Government Bond Euro High Quality Government Bond (liquidé le 23 mai 2023) Euro Medium Term Bond Europe High Conviction Bond Flexible Global Credit Seasons | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des liquidités |
| Multi-Asset Opportunities (anciennement Emerging Multi-Asset Income) | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK (y compris gestion des devises et mise en œuvre des futures), Alfred Berg AS, Suède , BNPP AM Asia , BNPP AM Brazil, BNPP AM UK (gestion des devises) A partir du 27 octobre 2023 : BNPP AM UK (y compris gestion des devises et mise en œuvre des futures) qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM France |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Gestionnaires financiers |
|---|---|
| Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023) Euro Corporate Bond Opportunities Euro Corporate Green Bond Euro Short Term Corporate Bond Opportunities Europe Convertible Europe Real Estate Securities Harmony (absorbé le 29 juin 2023) Sustainable Europe Value Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises et des liquidités |
| Green Bond | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK (y compris gestion des devises et des liquidités) BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Euro Corporate Bond Europe Small Cap Europe Small Cap Convertible Global Absolute Return Multi-Factor Bond Inclusive Growth Multi-Asset Thematic Social Bond Sustainable Euro Corporate Bond Sustainable Europe Dividend Target Risk Balanced | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises et des liquidités BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Euro High Yield Bond | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises et des liquidités BNPP AM UK (y compris gestion des devises) |
| Sustainable Europe Multi-Factor Equity | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises |
| Sustainable Global Multi-Factor Equity Sustainable Multi-Asset Flexible Sustainable US Value Multi-Factor Equity | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises BNPP AM UK (gestion des devises) |
| RMB Bond | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK (y compris la gestion des devises) BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Global Enhanced Bond 36M | BNPP AM France BNPP AM UK (gestion des devises) A partir du 1 juin 2023 : BNPP AM UK (y compris gestion des devises et mise en œuvre des futures) qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM France et BNPP AM USA |
| Enhanced Bond 6M Sustainable Global Low Vol Equity Sustainable US Multi-Factor Equity | BNPP AM France BNPP AM UK (gestion des devises) |
| China A-Shares | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM Asia |
| China Equity | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM Asia BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Global Convertible Sustainable Enhanced Bond 12M Sustainable Euro Bond Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des liquidités BNPP AM UK (gestion des devises) |
| Euro Defensive Equity | BNPP AM Nederland qui recourt aux services de BNPP AM France |

BNP PARIBAS FUNDS

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Gestionnaires financiers |
|--|---|
| Ecosystem Restoration Energy Transition Euro High Yield Short Duration Bond Europe Growth Sustainable Global Equity | BNPP AM UK (y compris gestion des devises et des liquidités) |
| Emerging Bond Emerging Bond Opportunities Emerging Markets Climate Solutions Local Emerging Bond Sustainable Asian Cities Bond | BNPP AM UK (y compris gestion des devises, gestion des liquidités et mise en œuvre des futures) |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH) | BNPP AM UK (y compris gestion des devises et mise en œuvre des futures) |
| Euro Equity | BNPP AM UK (y compris gestion des devises et des liquidités) BNPP AM France |
| Global Inflation-Linked Bond | BNPP AM UK (y compris gestion des devises) BNPP AM USA |
| Global Bond Opportunities | BNPP AM UK (y compris gestion des devises, gestion des liquidités et mise en œuvre des futures) BNPP AM USA BNPP AM France A partir du 1 juillet 2023 : BNPP AM UK (y compris gestion des devises, gestion des liquidités et mise en œuvre des futures) qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM USA |
| Europe Equity | BNPP AM UK BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises et des liquidités |
| Global High Yield Bond Sustainable Global Corporate Bond | BNPP AM USA qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises et des liquidités BNPP AM France BNPP AM UK (y compris gestion des devises) |
| Euro Bond Opportunities | BNPP AM USA BNPP AM France qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises, la gestion des liquidités et la mise en œuvre des futures A partir du 1 juin 2023 : BNPP AM UK (y compris gestion des devises, gestion des liquidités et mise en œuvre des futures) qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM France et BNPP AM USA |
| USD Short Duration Bond | BNPP AM UK (y compris gestion des devises et des liquidités) qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM USA (à partir du 1 décembre 2023) |
| Euro Inflation-Linked Bond | BNPP AM USA qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises et des liquidités |
| Emerging Equity India Equity | BNPP AM Asia |
| Consumer Innovators Disruptive Technology Health Care Innovators US Growth US Mid Cap US Small Cap | BNPP AM USA qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des liquidités BNPP AM UK (gestion des devises) |
| US High Yield Bond | BNPP AM USA qui a sous-délégué ses fonctions à BNPP AM UK pour la gestion des devises et des liquidités BNPP AM UK (gestion des devises) |

Notes aux états financiers au 31/12/2023

| Compartiment | Gestionnaires financiers |
|--|--|
| Aqua Climate Impact Global Environment Green Tigers SMaRT Food | <u>Impax</u> <u>BNPP AM UK</u> (gestion des devises) |
| Japan Equity | <u>MUKAM</u> <u>BNPP AM UK</u> (gestion des devises) |
| Japan Small Cap | <u>Sumitomo</u> <u>BNPP AM UK</u> (gestion des devises) |
| Turkey Equity | <u>TEB</u> qui a sous-délégué ses fonctions à <u>BNPP AM UK</u> pour la gestion des devises |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | <u>BNPP AM France</u> qui a sous-délégué ses fonctions à <u>BNPP AM UK</u> pour la gestion des devises et des liquidités <u>BNPP AM UK</u> (gestion des devises) |
| Asia High Yield Bond | <u>BNPP AM UK</u> |
| Global Climate Solutions | <u>BNPP AM UK</u> (y compris gestion des devises) |

Note 21 - Frais de transaction

Les frais de transaction encourus par la Société au titre de l'achat ou de la vente de valeurs mobilières, d'instruments du marché monétaire, de produits dérivés ou d'autres actifs éligibles comprennent essentiellement les frais de base, les frais divers sur les transactions, les droits de timbre, les commissions de courtage, les frais de conservation, la TVA, les taxes boursières et les frais RTO (réception et transmission des ordres).

Conformément aux pratiques en vigueur sur les marchés obligataires, un spread entre cours acheteur et cours vendeur est appliqué lors de l'achat ou de la vente de titres et d'autres instruments financiers. Par conséquent, il y aura dans le cadre de toute transaction une différence entre les prix d'achat et de vente fixés par le courtier, laquelle constitue la rémunération du courtier.

Le spread entre cours acheteur et cours vendeur n'est pas inclus à la rubrique « Frais de transaction » de l'Etat des opérations et des changements des actifs nets.

Note 22 - Recouvrement d'impôt dans le cadre du projet Aberdeen/Fokus Bank

Dans certains pays de l'Union européenne, le droit communautaire permet aux organismes de placement collectif (OPC) d'introduire une demande en recouvrement des impôts qu'ils ont été injustement contraints de payer. Le droit communautaire juge discriminatoire qu'un Etat membre puisse imposer plus lourdement un OPC étranger qu'un OPC résident.

Ce principe de jurisprudence a été confirmé par l'Arrêt de la Cour de justice de l'Union européenne (CJUE) rendu le 18 juin 2009 dans le cadre de la procédure engagée par la société Aberdeen. La Cour a estimé qu'une différence de traitement fiscal entre OPC résidents et non résidents pouvait être discriminatoire pour les OPC non résidents, ce qui constitue une entrave à la liberté d'établissement et/ou à la libre circulation du capital. D'autres arrêts rendus par la CJUE ont par la suite confirmé cette jurisprudence : l'arrêt Santander du 10 mai 2010 ou l'arrêt Marchés émergents du 10 avril 2014 par exemple, relatifs à la législation fiscale française et polonaise respectivement.

A la lumière de cette jurisprudence et afin de préserver le droit des OPC à obtenir le remboursement des impôts injustement prélevés, la Société de Gestion a décidé d'introduire des demandes de recouvrement auprès des autorités fiscales de plusieurs Etats membres dont la législation discriminatoire est contraire au droit communautaire. Des études préliminaires seront réalisées afin de déterminer si les demandes ont des chances d'aboutir (pour quels fonds, dans quels Etats membres, sur quelle période convient-il de demander un remboursement ?).

Il n'existe pas à l'heure actuelle de cadre législatif uniforme au niveau européen pour ce type de demande. Par conséquent, le délai de remboursement et la complexité de la procédure pourront varier sensiblement d'un Etat membre à l'autre. Il est donc indispensable de suivre en continu les développements en la matière.

En raison des incertitudes entourant la recouvrabilité des montants, aucun compte de régularisation n'est mis en place. Les montants sont comptabilisés sous le poste « Revenus sur titres et avoirs, nets » à leur réception.

Notes aux états financiers au 31/12/2023

Note 23 - Fonds monétaires

Le 14 juin 2017, le Parlement européen et le Conseil de l'Union européenne ont publié le Règlement 2017/1131 sur les fonds monétaires (le « Règlement MMF ») entrant en vigueur le 20 juillet 2018.

Au 31 décembre 2023, les compartiments suivants de la Société sont considérés comme des fonds monétaires à valeur liquidative variable à court terme et entrent dans le champ d'application de l'article 16.4 du Règlement MMF, mais investissent moins de 10% de leurs actifs dans d'autres fonds monétaires :

- Euro Money Market
- USD Money Market

Note 24 - Recouvrement de l'impôt belge perçu en Belgique

La Société de Gestion a introduit des demandes de recouvrement auprès de l'administration fiscale belge afin de protéger les droits de la SICAV, et par là même les intérêts des actionnaires, à bénéficier d'un remboursement de l'impôt belge prélevé. Tout remboursement d'impôt est subordonné à l'achèvement des procédures judiciaires et des procès en cours.

En raison des incertitudes entourant la recouvrabilité des montants, aucun compte de régularisation n'est mis en place. Les montants sont comptabilisés sous le poste « Revenus sur titres et avoirs, nets » à leur réception.

Note 25 - Déclaration SFDR

La note SFDR relative aux Art 8 et/ou Art 9 est disponible, libre de charge, dans le rapport annuel officiel du Fonds (en anglais).

Note 26 - Evénement significatif

Depuis le 24 février 2022, le Conseil d'Administration s'est montré très attentif aux implications du conflit entre la Russie et l'Ukraine, ainsi qu'à ses répercussions en termes de pénurie d'énergie et d'approvisionnement alimentaire en Europe. Le Conseil d'Administration surveille de près la situation géopolitique et son impact sur les perspectives globales et les risques de marché et financier afin de prendre toutes les mesures nécessaires dans l'intérêt des actionnaires.

Note 27 - Evénements postérieurs à la clôture

Les dividendes mensuels ont été versés le 5 janvier 2024 au titre des actions en circulation le 29 décembre 2023, avec une date ex-dividende au 2 janvier 2024.

Le compartiment BNP Paribas Flexi I Lyra sera fusionné avec le compartiment BNP Paribas Funds Global Enhanced Bond 36M avec effet au 8 mars 2024.

Le compartiment BNP Paribas Funds Global Net Zero Transition Equity sera lancé le 15 mars 2024.

Au 1 mars 2024, la société BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France sera renommée BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe.

En conséquence, BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Succursale de Belgique deviendra BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Succursale de Belgique, tandis que BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT France, Succursale des Pays-Bas deviendra BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Europe, Succursale des Pays-Bas.

Annexe non audité

Exposition globale au risque de marché

Après évaluation du profil de risque, la Société de Gestion de la Société adopte l'approche par les engagements ou la méthode de la VaR (99%, un mois) afin de mesurer l'exposition globale au risque de marché.

L'effet de levier correspond à la somme des valeurs notionnelles de tous les instruments financiers dérivés utilisés.

Les informations concernant l'exposition globale aux risques de marché pour l'exercice clôturé le 31 décembre 2023 sont les suivantes :

| Compartiment | Méthode de calcul du risque global | Type de VaR | Portefeuille de référence | Limite de VaR | Utilisation minimale de la limite de VaR | Utilisation maximale de la limite de VaR | Utilisation moyenne de la limite de VaR | Niveau de levier moyen constaté au cours de l'exercice |
|--|------------------------------------|----------------|--|---------------|--|--|---|--|
| Emerging Bond | VaR relative | VaR historique | JPM EMBI Global Diversified | 200% | 119,95% | 182,96% | 134,31% | 51,72% |
| Environmental Absolute Return Thematic Equity (EARTH)* | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 11,25% | 22,55% | 19,65% | 56,02% |
| Euro Bond Opportunities | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 5,44% | 17,99% | 7,26% | 472,35% |
| Euro Defensive Equity | VaR relative | VaR historique | MSCI EMU | 200% | 71,29% | 88,64% | 81,58% | 29,71% |
| Euro Flexible Bond | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 1,52% | 2,68% | 2,01% | 192,09% |
| Euro High Yield Bond | VaR relative | VaR historique | ICE BofAML BB-B European Currency Non-Financial High Yield Constrained | 200% | 77,69% | 111,26% | 91,56% | 21,25% |
| Euro Short Term Corporate Bond Opportunities | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 2,58% | 3,85% | 3,20% | 74,72% |
| Europe Convertible | VaR relative | VaR historique | UBS Thomson Reuters Europe Hedged Convertible Bond (EUR) | 200% | 79,57% | 120,10% | 91,36% | 46,11% |
| Europe Small Cap Convertible | VaR relative | VaR historique | UBS Thomson Reuters Europe Convertible Bond (EUR) | 200% | 63,51% | 98,59% | 76,41% | 40,00% |
| Flexible Global Credit | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 1,41% | 2,80% | 2,25% | 75,93% |
| Global Absolute Return Multi-Factor Bond | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 1,52% | 2,42% | 1,88% | 133,39% |
| Global Bond Opportunities | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 4,95% | 18,41% | 7,10% | 635,06% |
| Global Convertible | VaR relative | VaR historique | Thomson Reuters Global Focus Hedged Convertible Bond (EUR) | 200% | 32,30% | 108,67% | 96,92% | 68,52% |
| Global Enhanced Bond 36M | VaR absolue | VaR historique | Pas d'indice de référence | 20% | 2,05% | 17,37% | 4,23% | 722,36% |
| Global Inflation-Linked Bond | VaR relative | VaR historique | Bloomberg WLD Government Inflation Linked All Mat (EUR HD) | 200% | 97,10% | 111,19% | 102,13% | 114,32% |

Annexe non auditée

| Compartiment | Méthode de calcul du risque global | Type de VaR | Portefeuille de référence | Limite de VaR | Utilisation minimale de la limite de VaR | Utilisation maximale de la limite de VaR | Utilisation moyenne de la limite de VaR | Niveau de levier moyen constaté au cours de l'exercice |
|---|------------------------------------|----------------|---|---------------|--|--|---|--|
| Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond | VaR relative | VaR historique | ICE BOFAML Euro Corporate Index | 200% | 90,14% | 102,63% | 100,06% | 26,11% |
| Sustainable Global Multi-Factor Corporate Bond | VaR relative | VaR historique | Bloomberg Global Aggregate Corporate Index USD Hedged | 200% | 103,54% | 145,38% | 105,81% | 67,21% |
| Sustainable Global Multi-Factor High Yield Bond | VaR relative | VaR historique | ICE BofAML Global High Yield Constrained Index USD Hedged | 200% | 86,49% | 127,68% | 96,00% | 49,40% |
| Sustainable US Multi-Factor Corporate Bond | VaR relative | VaR historique | ICE BOFAML US CORPORATE INDEX | 200% | 99,58% | 111,02% | 105,35% | 27,59% |

La volatilité du marché a donné lieu à plusieurs dépassements passifs des limites de la VaR.

* Tous les dépassements de la VaR réglementaire ont fait l'objet d'une analyse détaillée, régulièrement mise à jour. Sur la base de ces critères, ils ont tous été classés comme des dépassements passifs entre leur survenance et le 31 décembre 2023.

Les compartiments qui n'apparaissent pas dans le tableau ci-dessus utilisent l'approche par les engagements pour mesurer et contrôler leur exposition globale.

Annexe non audité

Informations concernant la Politique de rémunération de la Société de Gestion

Ci-après figurent des informations quantitatives en matière de rémunérations, telles que requises par l'article 22 de la directive AIFM (directive 2011/61/CE du 8 juin 2011) et par l'article 69 (3) de la directive OPCVM V (directive 2014/91/UE du 23 juillet 2014), dans un format conforme aux recommandations de l'AFG (Association française de la gestion financière)¹.

Rémunération globale des employés de BNPP AM Luxembourg (art. 22-2-e de la directive AIFM et art. 69-3 (a) de la directive OPCVM V) :

| | Nombre d'employés | Rémunération totale (en milliers EUR) (fixe + variable) | dont rémunération variable totale (EN MILLIERS EUR) |
|---|-------------------|---|---|
| Ensemble des employés de BNPP AM Luxembourg | 101 | 9 906 | 1 117 |

Rémunération globale des employés de BNPP AM Luxembourg dont les activités ont un impact important sur le profil de risque de la société et qui sont des « Employés identifiés »² (art. 22-2-f de la directive AIFM et art. 69-3 (b) de la directive OPCVM V) :

| Domaine d'activité | Nombre d'employés | Rémunération totale (en milliers EUR) |
|--|-------------------|---------------------------------------|
| Employés identifiés de BNPP AM Luxembourg | 4 | 919 |
| <i>dont gestionnaires de portefeuille de FIA/OPCVM et de mandats européens</i> | - | - |

Autres informations :

➤ Nombre de FIA et d'OPCVM gérés par BNPP AM Luxembourg :

| | Nombre de fonds au 31/12/2023 | Encours sous gestion (en milliards EUR) au 31/12/2023 ³ |
|-------|-------------------------------|--|
| OPCVM | 193 | 132 |
| FIA | 20 | 3 |

- La politique globale de rémunération de BNP Paribas Asset Management et sa mise en œuvre au cours de l'exercice 2022 ont fait l'objet d'un audit indépendant et centralisé mené sous la supervision du comité de rémunération et du Conseil d'Administration de BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT Holding entre juillet et septembre 2023. Suite à cet audit couvrant les entités de BNP Paribas Asset Management détenant une licence AIFM et/ou OPCVM, la note de « Globalement satisfaisant » a été attribuée, mettant ainsi en évidence la solidité des mesures en place, notamment lors des étapes clés : identification des employés réglementés, cohérence entre performance et rémunération, application de réglementations en matière de rémunération différée, mise en œuvre des mécanismes d'indexation et de rémunération différée. Une recommandation - non présentée comme une alerte - a été émise en 2023, signalant que le cadre régissant les politiques de rémunération des sociétés de gestion par délégation externes ne garantissait pas un alignement suffisant sur les exigences réglementaires et devait être davantage documenté.
- De plus amples détails sur la détermination des rémunérations variables figurent dans les informations qualitatives relatives à la politique de rémunération, qui sont disponibles sur le site Internet de la société.

¹ NB : Les montants des rémunérations indiqués ci-dessus ne peuvent pas être rapprochés directement des données comptables de l'exercice car ils reflètent le salaire annuel de base des employés au 31 décembre 2023, et les montants attribués au terme du processus de contrôle annuel des rémunérations variables en mars 2024, que cette rémunération variable soit différée ou non.

² La liste des Employés identifiés est déterminée sur la base des effectifs en fin d'année.

³ Les montants communiqués incluent les fonds de type « maître-nourricier ».

Annexe non auditée**Réglementation sur la transparence des opérations de financement sur titres et la réutilisation des garanties (SFTR)****1. Swaps sur rendement total**

Cette garantie s'applique à toutes les activités de gré à gré réalisées par la Société en lien avec des contrats de swap sur rendement total.

Seasons

| Nom de la contrepartie | Type | Compartiment Devise | Valeur de marché (absolue) | Echéance | Conservation des garanties reçues | Conservation des garanties fournies | Réinvestissement |
|-------------------------------|------|------------------------|-------------------------------|--------------------|---|---|------------------|
| J.P. MORGAN AG | Cash | EUR | 41 490 000 | Moins d'un jour | S/O | Comptes groupés | S/O |
| Total (valeur absolue) | | EUR | 41 490 000 | | | | |

Données de coût/rendement

Les Swaps sur rendement total n'ont donné lieu à aucun partage de commissions et l'intégralité des coûts/rendements supportés/dégagés sont comptabilisés dans les principaux états financiers de la Société.

2. Prêt de titres

La Société a conclu des opérations de prêt de titres au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023. Ces opérations sont soumises aux exigences du Règlement (UE) 2015/2365 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation.

Au 31 décembre 2023, les compartiments ne présentent aucun prêt de titres.

La Société perçoit une rémunération en lien avec ces opérations de prêt. Cette rémunération est reprise au compte « Revenus sur titres et avoirs, nets » dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets. L'Agence (BNPP SA) reçoit une commission de 15% des intérêts perçus et la Société de Gestion (BNP Paribas Asset Management), une commission de 15% des intérêts perçus, en rémunération des services qu'elle fournit à la Société dans le cadre des opérations de prêt de titres.

Garanties en lien avec les prêts de titres

Dans le cadre des opérations de prêt, les compartiments de la SICAV reçoivent une garantie (sous la forme d'obligations émises ou garanties par un gouvernement ou une collectivité régionale ou locale d'un Etat membre de l'OCDE, par les branches locales, régionales ou internationales d'institutions ou d'organismes supranationaux ayant une notation d'au moins AA et/ou par des émetteurs de premier ordre présentant une liquidité adéquate), dont la valeur au moment de la conclusion du contrat de prêt est au moins égale à 105% de la valeur de marché totale des titres prêtés.

Informations sur les rendements et les coûts

Les compartiments perçoivent une rémunération en lien avec les contrats de prêt de titres. Cette rémunération est reprise au compte « Revenus sur titres et avoirs, nets » dans l'Etat des opérations et des changements des actifs nets. L'Agence (BNPP SA) reçoit une commission de 15% des intérêts perçus et la Société de Gestion (BNP Paribas Asset Management), une commission de 15% des intérêts perçus, en rémunération des services qu'elle fournit à la SICAV dans le cadre des opérations de prêt de titres.

Informations sur la réutilisation des garanties

Les garanties reçues sous la forme de titres ou en espèces n'ont pas été réutilisées au cours de l'exercice clôturé le 31 décembre 2023.

Annexe non audité

Eligibilité au Plan d'Épargne en Actions (PEA)

Étant donné qu'ils sont éligibles au Plan d'Épargne en Actions (PEA), les compartiments de la Société dont la liste figure ci-dessous investissent en permanence au moins 75% de leurs actifs nets dans des actions et des droits éligibles au PEA émis par des sociétés qui ont leur siège en France, dans un autre État membre de l'Union européenne ou en Islande ou en Norvège et qui sont soumises à l'impôt sur les sociétés ou à un régime équivalent.

- Euro Defensive Equity
- Euro Equity
- Nordic Small Cap
- Seasons
- Sustainable Euro Low Vol Equity
- Sustainable Euro Multi-Factor Equity
- Sustainable Europe Value

Transparence de la promotion des caractéristiques environnementales ou sociales et des investissements durables

I - Approche de BNP Paribas Asset Management

Conformément à l'article 3 du Règlement 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (SFDR), BNP Paribas Asset Management met à disposition des investisseurs, sur son site Internet, sa politique relative à la prise en compte des risques en matière de durabilité dans ses processus de prise de décisions d'investissement.

En outre, BNP Paribas Asset Management fournira aux investisseurs et au public un document décrivant sa politique d'intégration des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance dans sa stratégie d'investissement, les ressources consacrées à la transition énergétique et écologique et sa stratégie de mise en œuvre de cette politique. Ces informations relèveront des exigences de transparence des informations relatives aux incidences négatives sur la durabilité, et seront accessibles sur le site Internet de la Société de Gestion conformément à l'article 4 du Règlement SFDR.

Le Règlement SFDR définit les règles de transparence et de communication d'informations en matière de durabilité.

Outre le Règlement SFDR, le Règlement (UE) 2020/852 du Parlement européen et du Conseil du 18 juin 2020 relatif à l'établissement d'un cadre visant à favoriser les investissements durables et modifiant le Règlement SFDR (Règlement Taxonomie) vise à établir des critères permettant de déterminer si une activité économique est durable sur le plan environnemental.

Le Règlement Taxonomie européen est donc un système de classification établissant une liste d'activités économiques considérées comme durables sur le plan environnemental.

Les activités économiques qui ne sont pas reconnues par le Règlement Taxonomie ne sont pas nécessairement préjudiciables à l'environnement ou non durables. En outre, les autres activités qui contribuent de manière significative aux objectifs environnementaux et sociaux ne sont pas encore toutes citées dans le Règlement Taxonomie.

L'approche générale actuelle de BNP Paribas Asset Management concernant la prise en compte des critères environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) est détaillée sur notre site Internet :

<https://www.bnpparibas-am.com/en/sustainability-bnpp-am/our-approach/>

Pour BNP Paribas Asset Management, l'investissement responsable repose sur six piliers. Les quatre premiers piliers contribuent à l'amélioration de nos pratiques de gestion, et ce notamment via des idées d'investissement nouvelles, l'optimisation de la composition de nos portefeuilles, le contrôle des risques et l'exercice de notre influence sur les entreprises et les différents marchés dans lesquels nous investissons.

Annexe non audité

Intégration des critères ESG :

Nos analystes et gérants prennent en compte de manière systématique les facteurs ESG les plus pertinents, quel que soit le processus d'investissement. Nos directives et notre politique en matière d'intégration ESG s'appliquent à tous nos processus d'investissement (et donc aux fonds, mandats et fonds thématiques). Cependant, elles ne sont pas toutes applicables aux fonds indiciaires, aux fonds indiciaires cotés (ETF) et, sauf exception, aux processus de gestion spéciaux. Conformément aux convictions de BNP Paribas Asset Management, cette démarche nous permet d'identifier des risques et des opportunités dont les autres acteurs du marché n'ont pas nécessairement connaissance, ce qui nous confère un avantage concurrentiel. Le processus d'intégration des facteurs ESG est régi par des principes formels communs. Depuis 2020, chaque processus d'investissement – et, par définition, chaque stratégie d'investissement éligible – a été examiné et approuvé par le comité de validation ESG.

Vote, dialogue et engagement :

Nous investissons de manière réfléchie et avons établi des directives détaillées en matière de vote sur un certain nombre d'enjeux ESG. De plus, nous considérons qu'un dialogue de plus grande qualité avec les émetteurs peut améliorer nos processus d'investissement et nous aider à mieux contrôler les risques à long terme. Nos gérants et les experts du « Sustainability Center » de BNP Paribas Asset Management s'engagent auprès des entreprises dans lesquelles nous investissons, afin de les inciter à rendre leurs pratiques responsables et respectueuses de l'environnement.

Nous cherchons également à rencontrer régulièrement les représentants des pouvoirs publics pour discuter des moyens de lutter contre le réchauffement de la planète. Notre politique en matière de gouvernance et de vote est disponible à l'adresse suivante : <https://docfinder.bnpparibas-am.com/api/files/bc3ebf85-65ee-4a8f-8260-c146fb5960e1>

Conduite responsable des entreprises et exclusions sectorielles :

Dans tous ses investissements, BNP Paribas Asset Management applique des exclusions ESG basées sur les dix principes du Pacte mondial des Nations Unies. Le Pacte mondial des Nations Unies est un cadre de référence universel pour l'évaluation des entreprises, et s'applique à tous les secteurs économiques. Il repose sur les conventions internationales signées dans les domaines des droits humains, des droits du travail, de l'environnement et de la lutte contre la corruption.

Outre les principes du Pacte mondial des Nations Unies, BNP Paribas Asset Management applique également les Principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises. Les sociétés intervenant dans certains secteurs sensibles aux impacts sociaux et environnementaux doivent respecter des normes ESG spécifiques. Celles-ci sont définies dans des politiques sectorielles, couvrant pour l'instant les activités liées à l'huile de palme, à la pâte à papier, au charbon, à l'énergie nucléaire, aux armes controversées, au pétrole et au gaz non conventionnels, à l'extraction minière, à l'amiante, à l'agriculture et au tabac. Le non-respect des normes ESG déterminées par BNP Paribas Asset Management conduit à exclure les entreprises concernées du périmètre d'investissement. Enfin, conformément aux réglementations applicables, certains secteurs comme les armes controversées (mines antipersonnel et armes à sous-munitions) sont écartés d'office du périmètre d'investissement.

La politique de conduite responsable des entreprises de BNPP AM et ses différentes composantes sont disponibles à l'adresse suivante : <https://docfinder.bnpparibas-am.com/api/files/D8E2B165-C94F-413E-BE2E-154B83BD4E9B>

Une vision prospective :

Nous pensons que trois points clés sous-tendent un système économique plus durable et plus inclusif : la transition énergétique, la protection de l'environnement et l'égalité. Nous avons défini un ensemble d'objectifs et mis au point des indicateurs de performance pour mesurer comment nous alignons notre recherche, nos portefeuilles et notre engagement auprès des entreprises et des pouvoirs publics sur ces trois enjeux, les « 3E ».

Gamme d'OPC avec une approche extrafinancière renforcée

Une partie de notre gamme intègre les quatre piliers fondamentaux de notre approche durable : il s'agit de stratégies « ESG renforcé », couvrant des fonds multifactoriels, best-in-class et labellisés, de stratégies « thématiques » investissant dans des sociétés dont les produits et services apportent des solutions concrètes aux défis environnementaux et/ou sociaux, et enfin, de stratégies « d'impact » visant à générer, en plus de la performance financière, un impact environnemental et/ou social intentionnel positif et mesurable.

Annexe non audité

Notre démarche RSE

En tant qu'investisseurs durables, nos pratiques internes se doivent d'être au moins à la hauteur de nos exigences envers les entreprises dans lesquelles nous investissons. C'est pourquoi nous intégrons le développement durable dans nos propres activités opérationnelles et civiques, avec les priorités suivantes : garantir l'égalité des genres parmi nos employés, réduire nos déchets et nos émissions de CO2, et œuvrer à l'inclusion des jeunes.

Les résultats de notre démarche en matière de durabilité sont résumés dans notre rapport extrafinancier disponible sur notre site Internet :

<https://docfinder.bnpparibas-am.com/api/files/20B0B5A3-B05F-4CD1-B7E5-2F2536D52581>

L'approche des compartiments de BNP Paribas Funds

Les informations en matière de durabilité ci-dessous s'entendent au 31 décembre 2023 (date de clôture des comptes de la SICAV).

| Compartiments | Classification SFDR | Informations supplémentaires |
|--|---|---|
| Absolute Return Global Opportunities (fusionné le 26 janvier 2023) | Compartiment ne faisant pas la promotion de caractéristiques environnementales, sociales ou de gouvernance et n'ayant pas pour objectif l'investissement durable au sens des articles 8 et 9 du Règlement SFDR. | Les investissements de la Société ne tiennent pas compte des critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental, tels que définis par le Règlement Taxonomie. |

VIEWPOINT



BNP PARIBAS
ASSET MANAGEMENT

L'investisseur
durable d'un
monde qui change