

**BNP Paribas Diversipierre - KPIs & Historical returns**
**Performance Overview as of 31/03/2023**

| Performances | Since inception | YTD 2023 | Last Quarter  | Last month | Last 15 days | Annualised performance since 31/12/2014 |       |
|--------------|-----------------|----------|---------------|------------|--------------|---|-------|
|              |                 | 25,24%   | <b>-2,69%</b> | -2,69%     | -3,43%       | -2,84%                                  | 2,68% |

  

| Annual performances | 2014 | 2015   | 2016   | 2017   | 2018   | 2019   | 2020   | 2021   | 2022   | Annualised performance over 8 years 2015-2022 |
|---------------------|------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|---|
|                     |      | +0,71% | +7,05% | +4,77% | +6,69% | +1,17% | +8,87% | -1,21% | +3,33% |   |

  

| Annualised volatility | 2014 | 2015  | 2016  | 2017  | 2018  | 2019  | 2020  | 2021  | 2022  | YTD 2023 | Since inception |
|-----------------------|------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|----------|-----------------|
|                       |      | 3,19% | 4,27% | 2,98% | 3,03% | 2,04% | 2,57% | 4,90% | 2,09% | 4,63%    | 5,89%           |

| Date VL   | NAV per share (€) | NAV (€)         | Number of shares | Dividends (€/share) | Performances    |        |              |            |              |
|-----------|-------------------|-----------------|------------------|---------------------|-----------------|--------|--------------|------------|--------------|
|           |                   |                 |                  |                     | Since inception | YTD    | Last Quarter | Last Month | Last 15 days |
| 31-Mar-22 | 126,65            | 2 647 658 802 € | 20 903 941       |                     | 35,74%          | 0,78%  | 0,78%        | 1,80%      | 1,82%        |
| 14-Apr-22 | 126,53            | 2 645 704 650 € | 20 908 861       |                     | 35,62%          | 0,68%  | 0,80%        | 1,72%      | -0,09%       |
| 29-Apr-22 | 124,01            | 2 593 775 199 € | 20 915 569       | 1,82                | 34,92%          | 0,13%  | 0,44%        | -0,65%     | -0,55%       |
| 13-May-22 | 123,12            | 2 575 711 584 € | 20 919 554       |                     | 34,03%          | -0,58% | 0,56%        | -1,26%     | -0,72%       |
| 31-May-22 | 123,50            | 2 629 586 599 € | 21 291 894       |                     | 34,41%          | -0,28% | 0,73%        | -0,41%     | 0,31%        |
| 15-Jun-22 | 121,92            | 2 626 613 948 € | 21 542 333       |                     | 32,83%          | -1,54% | -0,52%       | -0,97%     | -1,28%       |
| 30-Jun-22 | 121,65            | 2 625 505 245 € | 21 581 934       |                     | 32,56%          | -1,75% | -2,51%       | -1,50%     | -0,22%       |
| 15-Jul-22 | 122,18            | 2 657 002 854 € | 21 746 404       |                     | 33,09%          | -1,33% | -2,00%       | 0,21%      | 0,44%        |
| 29-Jul-22 | 123,51            | 2 701 197 702 € | 21 868 951       |                     | 34,42%          | -0,27% | -0,40%       | 1,53%      | 1,09%        |
| 12-Aug-22 | 123,67            | 2 704 704 045 € | 21 869 147       |                     | 34,58%          | -0,14% | 0,45%        | 1,22%      | 0,13%        |
| 31-Aug-22 | 121,93            | 2 676 844 747 € | 21 953 925       |                     | 32,84%          | -1,53% | -1,27%       | -1,28%     | -1,41%       |
| 15-Sep-22 | 121,45            | 2 671 801 910 € | 21 997 910       |                     | 32,36%          | -1,91% | -0,39%       | -1,80%     | -0,39%       |
| 30-Sep-22 | 119,53            | 2 629 849 441 € | 21 999 934       |                     | 30,44%          | -3,44% | -1,74%       | -1,97%     | -1,58%       |
| 14-Oct-22 | 119,28            | 2 643 875 068 € | 22 165 006       |                     | 30,19%          | -3,64% | -2,37%       | -1,79%     | -0,21%       |
| 31-Oct-22 | 120,39            | 2 679 916 273 € | 22 258 607       |                     | 31,30%          | -2,75% | -2,53%       | 0,72%      | 0,93%        |
| 15-Nov-22 | 121,26            | 2 704 201 027 € | 22 299 893       |                     | 32,17%          | -2,06% | -1,95%       | 1,66%      | 0,72%        |
| 30-Nov-22 | 120,74            | 2 692 493 671 € | 22 298 983       |                     | 31,65%          | -2,47% | -0,98%       | 0,29%      | -0,43%       |
| 15-Dec-22 | 120,95            | 2 685 044 170 € | 22 198 045       |                     | 31,86%          | -2,31% | -0,41%       | -0,26%     | 0,17%        |
| 30-Dec-22 | 117,49            | 2 598 107 658 € | 22 112 680       |                     | 28,40%          | -5,06% | -1,71%       | -2,69%     | -2,86%       |
| 13-Jan-23 | 118,85            | 2 624 170 381 € | 22 079 272       |                     | 29,76%          | 1,16%  | -0,36%       | -1,74%     | 1,16%        |
| 31-Jan-23 | 118,85            | 2 644 700 417 € | 22 252 009       |                     | 29,76%          | 1,16%  | -1,28%       | 1,16%      | 0,00%        |
| 15-Feb-23 | 118,53            | 2 631 522 773 € | 22 201 029       |                     | 29,44%          | 0,89%  | -2,25%       | -0,27%     | -0,27%       |
| 28-Feb-23 | 118,39            | 2 621 766 610 € | 22 143 842       |                     | 29,30%          | 0,77%  | -1,95%       | -0,39%     | -0,12%       |
| 15-Mar-23 | 117,67            | 2 605 077 144 € | 22 137 134       |                     | 28,58%          | 0,15%  | -2,71%       | -0,73%     | -0,61%       |
| 31-Mar-23 | 114,33            | 2 530 129 030 € | 22 129 432       |                     | 25,24%          | -2,69% | -2,69%       | -3,43%     | -2,84%       |

\*après publication de la VL

**Méthodologie de calcul des performances et de la volatilité :**

$$Performance = \frac{Valeur Liquidative de fin de période + Dividendes versés sur la période}{Valeur Liquidative en début de période} - 1$$

Volatilité annualisée =  $\sqrt[n]{\text{Ecart type des rendements des Valeurs Liquidatives du fonds (Dividendes réinvestis)} \times \text{Racine du nombre de périodes sur une année}}$

**Avertissement :** Les performances passées ne préjugent pas des performances futures, les investissements, soumis aux fluctuations des marchés, pouvant varier tant à la hausse qu'à la baisse.

**BNP PARIBAS REIM France**

SA au capital de 4 309 200 euros

Siège social : 50 cours de l'île Seguin, CS 50280 - 92650 Boulogne-Billancourt Cedex

Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le n° GP-07000031 en date du 1er juillet 2007 et du 15 avril 2014 au titre de la Directive AIFM