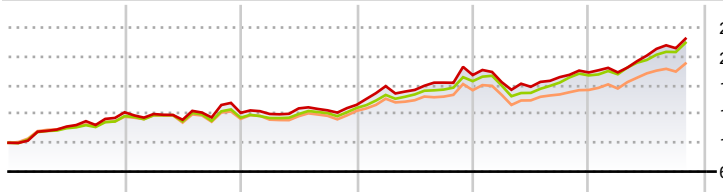
BNP Paribas Funds Responsible US Value Multi-Factor Equity ClassicD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Azionari USA Large Cap Value	Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD Usato nel Report	MSCI USA Value NR USD	★★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The implemented strategy aims at increasing the value of a portfolio of US equities, issued primarily by socially responsible companies, over the medium term using a systematic security selection approach combining several factor styles. At all times, this sub-fund invests at least 75% of its assets in equities and/or equity equivalent securities issued by companies that the management team considers to be under-valued as compared to the market on the purchase date and that have their registered office or conduct the majority of their business activities in the United States of America. The remaining portion, namely a maximum of 25% of its assets, may be invested in other equities, debt securities, money market instruments and provided...

Rendimenti



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	40,21	-0,53	7,63	26,13	1,80	23,09
Benchmark e Indici	35,19	-1,53	9,65	24,20	4,16	22,78
Categoria	34,46	-1,57	8,12	18,95	0,36	20,29

Misure di Rischio

3Y Alpha	-0,63	3Y Sharpe Ratio	1,21
3Y Beta	1,02	3Y Std Dev	13,15
3Y R-Squared	80,05	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,09	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	5,75	10Y Risk	-

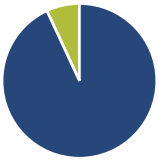
Basati su Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	3,02	5,89	3,53
6-Mesi	17,66	17,13	13,63
1-Anno	24,09	24,87	24,36
3-Anni Ann.ti	18,71	19,33	15,46
5-Anni Ann.ti	12,13	12,54	9,52
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 09/11/2026

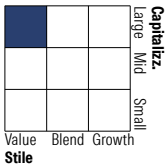
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	0,06	11,47	4,56	-
2025	-4,99	-3,34	7,31	3,29
2024	16,40	-2,88	5,69	5,57
2023	-1,05	5,32	-1,78	5,15
2022	-1,65	-5,48	2,36	4,55

Portafoglio 30/09/2026



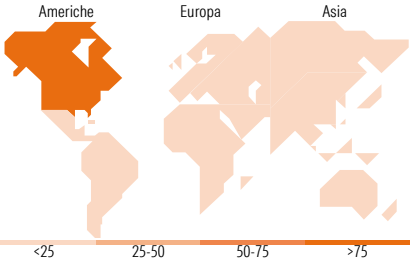
Asset Allocation %	Netta
Azioni	108,03
Obbligazioni	0,00
Liquidità	-8,03
Altro	0,00

Style Box Azionaria



Mkt Cap %	Fondo
Giant	12,62
Large	31,98
Medium	53,98
Small	1,41
Micro	0,00

Capitalizzazione media di mercato	Fondo
Ave Mkt Cap USD	113.384,03



Titoli principali

Nome	Settore	%
E-mini S&P 500 Future Dec 26	—	9,05
Johnson & Johnson		2,92
Bristol-Myers Squibb Co		2,46
Cardinal Health Inc		2,39
Cisco Systems Inc		2,37
The Travelers Companies Inc		2,29
Allstate Corp		2,24
Bank of New York Mellon Corp		2,20
Microsoft Corp		2,19
Charles Schwab Corp		2,16
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		30,27
Numero Complessivo di Titoli Azionari		95
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %	Fondo
Ciclico	**41,10**
Materie Prime	2,86
Beni di Consumo Ciclici	12,70
Finanza	25,40
Immobiliare	0,14
Sensibile	**27,83**
Telecomunicazioni	2,09
Energia	0,28
Beni Industriali	3,04
Tecnologia	22,42
Difensivo	**31,07**
Beni Difensivi	7,86
Salute	23,05
Servizi di Pubblica Utilità	0,16

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	**99,12**
Stati Uniti	99,11
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,01
Europa	**0,55**
Regno Unito	0,00
Europa Occidentale - Euro	0,00
Europa Occidentale - Non Euro	0,54
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,33**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,33

Anagrafica

Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg
Telefono	-
Web	-
Data di Partenza	18/09/2017
Nome del Gestore	Wadii El Moujil
Patrimonio Classe (Mln) (06/11/2026)	4,06 USD
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	USD
UCITS	Si
Inc/Acc	Inc
Investimento Min. Ingresso	-
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	-
Spese correnti	1,47%
Commissione di incentivo	-

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR

BNP Paribas Funds Responsible US Value Multi-Factor Equity ClassicD

Data Inizio Gestione	18/09/2017	ISIN	LU1458427868
NAV (09/11/2026)	USD 204,50		
Patrimonio Netto (MIn) (30/09/2026)	1.861,22 USD		

See disclosures for more details

© 2026 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

MORNINGSTAR