# BNP Paribas Funds Responsible US Value Multi-Factor Equity N R

**Categoria Morningstar™**
Azionari USA Large Cap Value

**Benchmark Morningstar**
Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD
Usato nel Report

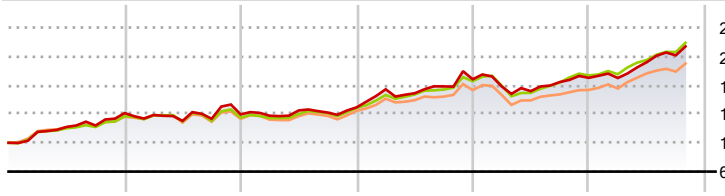
**Benchmark Dichiarato**
MSCI USA Value NR USD

**Morningstar Rating™**
★★★★

## 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 | 39,17 | -1,27 | 6,83 | 25,18 | 1,04 | 22,33 |
| 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 | -1,39 | 3Y Sharpe Ratio | 1,15 |
| 3Y Beta | 1,02 | 3Y Std Dev | 13,14 |
| 3Y R-Squared | 80,07 | 3Y Risk | +Med |
| 3Y Info Ratio | -0,25 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 5,75 | 10Y Risk | - |

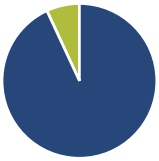
Basati su Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 2,92 | 7,30 | 3,96 |
| 6-Mesi | 17,86 | 18,36 | 14,56 |
| 1-Anno | 22,45 | 25,71 | 24,17 |
| 3-Anni Ann.ti | 17,21 | 19,78 | 15,74 |
| 5-Anni Ann.ti | 11,39 | 12,69 | 9,60 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 10/11/2026

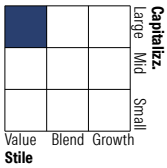
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -0,13 | 11,27 | 4,36 | - |
| 2025 | -5,16 | -3,51 | 7,10 | 3,10 |
| 2024 | 16,18 | -3,06 | 5,49 | 5,37 |
| 2023 | -1,24 | 5,13 | -1,96 | 4,96 |
| 2022 | -1,84 | -5,66 | 2,17 | 4,35 |

## Portafoglio 30/09/2026



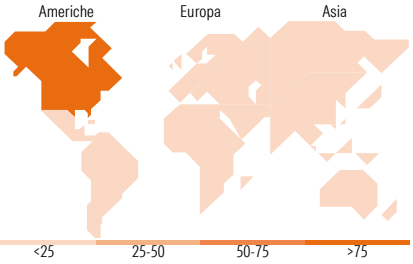
| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 108,03 |
| Obbligazioni | 0,00 |
| Liquidità | -8,03 |
| Altro | 0,00 |

**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) (10/11/2026) | 3,47 USD |
| Domicilio | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo | USD |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| Investimento Min. Ingresso | - |
| Investimento Min. Successivo | - |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | 2,23% |
| 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 N R

| | | | |
|---|---|---|---|
| Data Inizio Gestione | 18/09/2017 | ISIN | LU1458428320 |
| NAV (10/11/2026) | USD 259,35 | | |
| 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