BNP Paribas Funds Sustainable Europe Multi-Factor Equity N EUR Capitalisation

Categoria Morningstar™

Azionari Europa Large Cap Blend

Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

MSCI Europe NR EUR

Morningstar Rating™

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The implemented strategy aims at increasing the value of a portfolio of European 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 subfund invests at least 75% of its assets in equities and/ or equity equivalent securities issued by companies that have their registered offices or conduct the majority of their business activities in Europe. The remaining portion, namely a maximum of 25% of its assets, may be invested in other equities, debt securities and money market instruments, provided that investments in debt securities of any kind do not exceed 15% of its assets,

and up to 10% of its assets may be				
Misure di Rischio				
3Y Alpha	0,60	3Y Sharpe Ratio	0,98	
3Y Beta	0,95	3Y Std Dev	9,67	
3Y R-Squared	93,12	3Y Risk	-Med	
3Y Info Ratio	0,07	5Y Risk	-Med	
3Y Tracking Error	2,58	10Y Risk	-	

Basati su Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove

Rendimenti 150 125 100 75 2020 2021 2022 2023 2024 2025-11 -10,71 25,62 -12,90 16,80 10,63 14,67 Fondo Benchmark e -2,91 25,42 15,89 8,98 16,56 -9,67 Indici -1,25 22,95 -13,22 14,23 12,67 6,85 Categoria

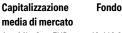
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2
3-Mesi	4,56	5,88	4,79	Trimestrali %		
6-Mesi	2,92	5,81	3,78	2025	6,15	1,64
1-Anno	11,41	14,41	11,11	2024	7,99	2,24
3-Anni Ann.ti	12,43	12,50	10,75	2023	10,27	2,35
5-Anni Ann.ti	10,47	11,10	9,37	2022	-5,76	-7,98
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	9,58	5,98
Rendimenti aggiornati al 04/12/1	2025					

Portafoglio 31/10/2025





Mkt Cap %	Fondo
Giant	47,03
Large	38,22
Medium	14,75
Small	0,00
Micro	0,00



Ave Mkt Cap EUR 48.410,8



Q3

2,84

3,49

-1,32

-6,59

-0,02

Q4

-3,18

4,88

7.54

8,19

Titoli principali		
Nome	Settore	%
MSCI Europe Index Net Total	_	12,24
ASML Holding NV		3,81
Novartis AG Registered Shares		3,24
Allianz SE		2,62
Unilever PLC	Ħ	2,57
AstraZeneca PLC	-	2,43
Banco Bilbao Vizcaya	#	2,36
ABB Ltd	‡	2,36
GSK PLC		2,34
Zurich Insurance Group AG		2,22
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		36,19
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	95
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	0

Distribuzione Settoriale %	Fondo
% Ciclico	33,40
A Materie Prime	0,37
Beni di Consumo Ciclici	7,20
🚅 Finanza	25,83
★ Immobiliare	-
₩ Sensibile	38,56
Telecomunicazioni	9,49
Tenergia	-
Beni Industriali	19,50
Tecnologia	9,57
→ Difensivo	28,05
📜 Beni Difensivi	10,82
■ Salute	15,08
Servizi di Pubblica Utilità	2,15

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	0,16
Stati Uniti	0,00
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,16
Europa	99,84
Regno Unito	22,12
Europa Occidentale - Euro	55,36
Europa Occidentale - Non Euro	22,24
Europa dell'Est	0,13
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	0,00
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,00
Asia - Emergente	0,00

_					
Λ	na	ai	2	Fi /	••

BNP Paribas Asset Società di Gestione Management Luxembourg Telefono +352 2646 3017 www.bnpparibas-am.com Web Data di Partenza 13/09/2019 Nome del Gestore

4,69 EUR Patrimonio Classe (MIn) (04/12/2025) LUSSEMBURGO Domicilio Valuta del Fondo **EUR UCITS** Si Inc/Acc Acc

Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo T.E.R. 2.23% Spese correnti 2,73% Commissione di incentivo

BNP Paribas Funds Sustainable Europe Multi-Factor Equity N EUR Capitalisation

Data Inizio Gestione 13/09/2019 ISIN LU1956135674

NAV (04/12/2025) EUR 154,92 Patrimonio Netto (MIn) 792,67 EUR

(31/10/2025)

