

# BNP Paribas Funds Sustainable Europe Multi-Factor Equity Classic EUR Distribution

## Categoria Morningstar™

Azione Europa Large Cap Blend

## Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Target  
Market Exposure NR EUR  
Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

MSCI Europe NR EUR

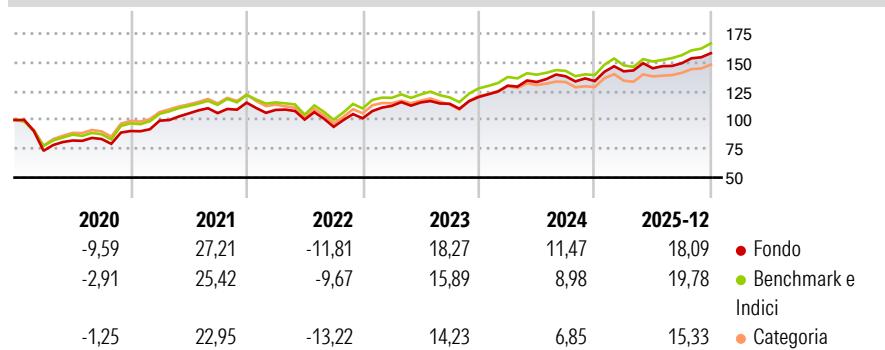
## Morningstar Rating™

★★★★

### 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 sub-fund 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...

### Rendimenti



### Misure di Rischio

|                   |       |                 |      |
|-------------------|-------|-----------------|------|
| 3Y Alpha          | 1,58  | 3Y Sharpe Ratio | 1,32 |
| 3Y Beta           | 0,94  | 3Y Std Dev      | 9,30 |
| 3Y R-Squared      | 92,52 | 3Y Risk         | -Med |
| 3Y Info Ratio     | 0,42  | 5Y Risk         | -Med |
| 3Y Tracking Error | 2,60  | 10Y Risk        | -    |

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

### Rend. Cumulati %

| Periodo        | Fondo | Bmk   | Cat   |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi         | 2,72  | 5,59  | 4,69  |
| 6-Mesi         | 8,85  | 11,33 | 8,78  |
| 1-Anno         | 15,18 | 18,11 | 14,36 |
| 3-Anni Ann.ti  | 13,69 | 13,12 | 11,15 |
| 5-Anni Ann.ti  | 11,09 | 11,11 | 9,10  |
| 10-Anni Ann.ti | -     | -     | -     |

Rendimenti aggiornati al 20/01/2026

### Rendimenti Trimestrali %

| Periodo | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|---------|-------|-------|-------|-------|
| 2026    | -     | -     | -     | -     |
| 2025    | 6,35  | 1,83  | 3,04  | 5,83  |
| 2024    | 8,20  | 2,43  | 3,69  | -3,00 |
| 2023    | 10,61 | 2,68  | -1,01 | 5,20  |
| 2022    | -5,48 | -7,69 | -6,29 | 7,86  |

### Portafoglio 30/11/2025



| Asset Allocation % | Netta  |
|--------------------|--------|
| • Azioni           | 105,24 |
| • Obbligazioni     | 0,00   |
| • Liquidità        | -6,83  |
| • Altro            | 1,59   |

### Style Box Azionaria

| Stile  | Capitalizz. |     |       |
|--------|-------------|-----|-------|
|        | Large       | Mid | Small |
| Value  |             |     |       |
| Blend  |             |     |       |
| Growth |             |     |       |

### Mkt Cap %

| Fondo  |
|--------|
| Giant  |
| Large  |
| Medium |
| Small  |
| Micro  |

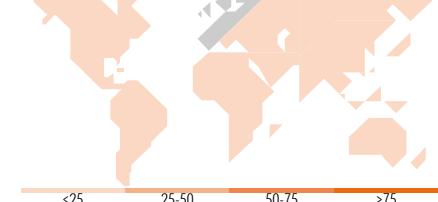
### Capitalizzazione media di mercato

| Fondo           |
|-----------------|
| Ave Mkt Cap EUR |

53.481,6

### Rendimenti

### Rendimenti Trimestrali %



### Titoli principali

| Nome  | Settore | %     |
|---|---------|-------|
| MSCI Europe Index Net Total...              | -       | 8,83  |
| ASML Holding NV                             | ☐       | 4,55  |
| Novartis AG Registered Shares               | ✚       | 3,35  |
| AstraZeneca PLC                             | ✚       | 3,12  |
| Allianz SE                                  | ☒       | 2,77  |
| Banco Bilbao Vizcaya...                     | ⌚       | 2,46  |
| ABB Ltd                                     | ⚙       | 2,39  |
| Deutsche Telekom AG                         | 📠       | 2,35  |
| Zurich Insurance Group AG                   | ⌚       | 2,29  |
| UniCredit SpA                               | ⌚       | 2,26  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 34,36 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 94    |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 0     |

### Distribuzione Settoriale %

| Fondo                         |
|-------------------------------|
| ● Ciclico                     |
| ■ Materie Prime               |
| ● Beni di Consumo Ciclici     |
| ■ Finanza                     |
| ■ Immobiliare                 |
| ▼ Sensibile                   |
| ■ Telecomunicazioni           |
| ■ Energia                     |
| ■ Beni Industriali            |
| ■ Tecnologia                  |
| ► Difensivo                   |
| ■ Beni Difensivi              |
| ■ Salute                      |
| ■ Servizi di Pubblica Utilità |

### Ripartizione Geografica %

| Fondo                           |
|---------------------------------|
| ● America                       |
| ■ Stati Uniti                   |
| ■ Canada                        |
| ■ America Latina e Centrale     |
| ■ Europa                        |
| ■ Regno Unito                   |
| ■ Europa Occidentale - Euro     |
| ■ Europa Occidentale - Non Euro |
| ■ Europa dell'Est               |
| ■ Africa                        |
| ■ Medio Oriente                 |
| ■ Asia                          |
| ■ Giappone                      |
| ■ Australasia                   |
| ■ Asia - Paesi Sviluppati       |
| ■ Asia - Emergenti              |

### Anagrafica

|                     |   |                         |             |                              |       |
|---------------------|---|-------------------------|-------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione | BNP Paribas Asset Management Luxembourg | Patrimonio Classe (Mln) | 4,52 EUR    | Investimento Min. Ingresso   | -     |
| Telefono            | +352 2646 3017                          | Domicilio               | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | -     |
| Web                 | www.bnpparibas-am.com                   | Valuta del Fondo        | EUR         | T.E.R.                       | 1,47% |
| Data di Partenza    | 13/09/2019                              | UCITS                   | Si          | Spese correnti               | 1,46% |
| Nome del Gestore    | Jean-Baptiste Simoen                    | Inc/Acc                 | Inc         | Commissione di incentivo     | -     |

## BNP Paribas Funds Sustainable Europe Multi-Factor Equity Classic EUR Distribution

|                        |            |      |              |
|------------------------|------------|------|--------------|
| Data Inizio Gestione   | 15/12/2022 | ISIN | LU1956135591 |
| NAV (20/01/2026)       | EUR 142,53 |      |              |
| Patrimonio Netto (Mln) | 823,16 EUR |      |              |
| (30/11/2025)           |            |      |              |