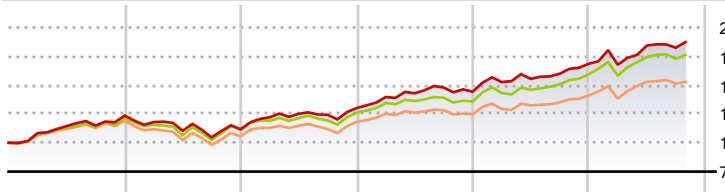
BNP Paribas Funds Sustainable Europe Multi-Factor Equity I EUR Capitalisation

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Azionari Europa Large Cap Blend	Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR Usato nel Report	MSCI Europe NR EUR	★★★★★

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



	2021	2022	2023	2024	2025	2026-10
Fondo	28,32	-11,04	19,29	12,44	19,10	12,37
Benchmark e Indici	25,42	-9,67	15,89	8,98	19,78	11,75
Categoria	22,95	-13,22	14,23	6,85	15,33	9,70

Misure di Rischio

3Y Alpha	1,20	3Y Sharpe Ratio	1,42
3Y Beta	0,97	3Y Std Dev	10,31
3Y R-Squared	90,05	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,27	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	3,26	10Y Risk	+Med

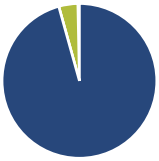
Basati su Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	-0,48	-3,61	-2,85
6-Mesi	5,37	1,79	2,77
1-Anno	16,35	13,52	12,92
3-Anni Ann.ti	15,98	14,02	12,30
5-Anni Ann.ti	9,77	8,27	6,31
10-Anni Ann.ti	9,94	9,12	7,85

Rendimenti aggiornati al 20/11/2026

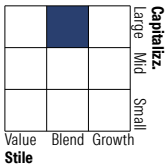
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-0,60	11,01	-1,11	-
2025	6,58	2,04	3,25	6,06
2024	8,43	2,66	3,92	-2,79
2023	10,84	2,91	-0,80	5,42
2022	-5,27	-7,49	-6,08	8,09

Portafoglio 30/09/2026



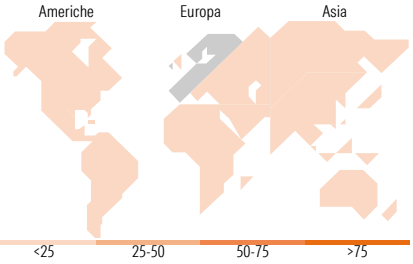
Asset Allocation %	Netta
Azioni	103,99
Obbligazioni	0,00
Liquidità	-4,34
Altro	0,35

Style Box Azionaria



Mkt Cap %	Fondo
Giant	43,06
Large	43,78
Medium	13,16
Small	0,00
Micro	0,00

Capitalizzazione media di mercato	Fondo
Ave Mkt Cap EUR	60.770,81



Titoli principali

Nome	Settore	%
ASML Holding NV		6,88
MSCI Europe Index Net Total...		5,71
Novartis AG Registered Shares		3,44
AstraZeneca PLC		3,35
Roche Holding AG Ordinary...		3,15
Allianz SE		2,66
ABB Ltd		2,60
Siemens Energy AG Ordinary...		2,48
GSK PLC		2,19
Sanofi SA		2,09
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		34,54
Numero Complessivo di Titoli Azionari		87
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %	Fondo
Ciclico	**35,01**
Materie Prime	0,85
Beni di Consumo Ciclici	4,83
Finanza	29,33
Immobiliare	-
Sensibile	**33,07**
Telecomunicazioni	2,73
Energia	-
Beni Industriali	19,09
Tecnologia	11,25
Difensivo	**31,92**
Beni Difensivi	6,93
Salute	21,91
Servizi di Pubblica Utilità	3,08

Ripartizione Geografica %	Fondo
America	**0,92**
Stati Uniti	0,23
Canada	0,00
America Latina e Centrale	0,68
Europa	**98,53**
Regno Unito	23,73
Europa Occidentale - Euro	57,57
Europa Occidentale - Non Euro	17,23
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,00
Medio Oriente	0,00
Asia	**0,55**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,55
Asia - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg	Patrimonio Classe (Mln) (20/11/2026)	307,00 EUR	Investimento Min. Ingresso	3.000.000 EUR
Telefono	-	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	-	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	13/09/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,61%
Nome del Gestore	Jean-Baptiste Simoen	Inc/Acc	Acc	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 Sustainable Europe Multi-Factor Equity I EUR Capitalisation

Data Inizio Gestione	15/12/2022	ISIN	LU1956135914
NAV (20/11/2026)	EUR 255,51		
Patrimonio Netto (MIn) (30/09/2026)	1.209,90 EUR		

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