

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

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

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

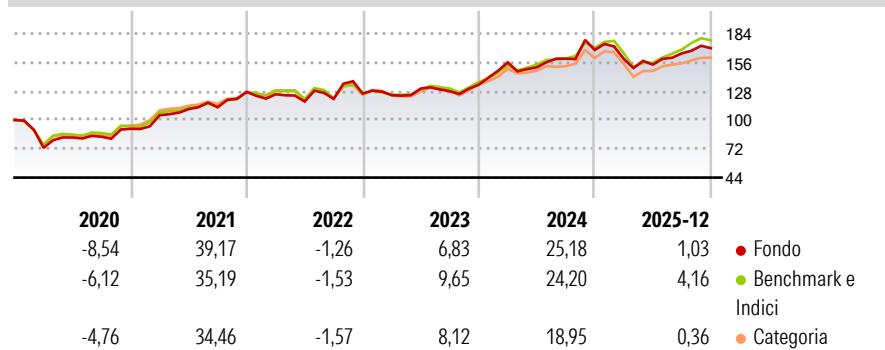
**Benchmark Dichiarato**  
MSCI USA Value NR USD

**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



## Misure di Rischio

|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -2,25 | 3Y Sharpe Ratio | 0,61  |
| 3Y Beta           | 1,08  | 3Y Std Dev      | 13,02 |
| 3Y R-Squared      | 85,39 | 3Y Risk         | +Med  |
| 3Y Info Ratio     | -0,36 | 5Y Risk         | +Med  |
| 3Y Tracking Error | 5,17  | 10Y Risk        | -     |

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

## Rend. Cumulati %

| Periodo        | Fondo | Bmk   | Cat   |
|----------------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi         | 3,92  | 3,24  | 4,07  |
| 6-Mesi         | 7,73  | 9,70  | 6,66  |
| 1-Anno         | -1,07 | 1,83  | -1,81 |
| 3-Anni Ann.ti  | 10,57 | 11,55 | 7,77  |
| 5-Anni Ann.ti  | 13,59 | 13,77 | 11,51 |
| 10-Anni Ann.ti | -     | -     | -     |

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

## Rendimenti Trimestrali %

| Periodo | Q1    | Q2    | Q3    | Q4   |
|---------|-------|-------|-------|------|
| 2026    | -     | -     | -     | -    |
| 2025    | -5,16 | -3,51 | 7,10  | 3,10 |
| 2024    | 16,17 | -3,05 | 5,49  | 5,36 |
| 2023    | -1,24 | 5,13  | -1,96 | 4,95 |
| 2022    | -1,83 | -5,66 | 2,17  | 4,35 |

## Portafoglio 31/12/2025



| Asset Allocation % | Netta  |
|--------------------|--------|
| • Azioni           | 108,06 |
| • Obbligazioni     | 0,00   |
| • Liquidità        | -8,06  |
| • Altro            | 0,00   |

## Style Box Azionaria

| Capitalizz. | Large | Mid   | Small  |
|-------------|-------|-------|--------|
| Style       | Value | Blend | Growth |
| Giant       |       |       |        |
| Large       |       |       |        |
| Medium      |       |       |        |
| Small       |       |       |        |
| Micro       |       |       |        |

## Mkt Cap %

| Fondo |
|-------|
| 12,30 |
| 32,67 |
| 53,69 |
| 1,33  |
| 0,00  |

## Capitalizzazione media di mercato

| Fondo                    |
|--------------------------|
| Ave Mkt Cap USD 90.337,1 |

## Americhe



## Europa



## Asia



## Distribuzione Settoriale %

| Fondo                            |
|----------------------------------|
| <b>38,88</b>                     |
| Materie Prime 3,43               |
| Beni di Consumo Ciclici 11,36    |
| Finanza 23,94                    |
| Immobiliare 0,15                 |
| <b>28,97</b>                     |
| Telecomunicazioni 2,08           |
| Energia 0,23                     |
| Beni Industriali 6,54            |
| Tecnologia 20,12                 |
| <b>32,15</b>                     |
| Beni Difensivi 3,40              |
| Salute 28,56                     |
| Servizi di Pubblica Utilità 0,19 |

## Ripartizione Geografica %

| Fondo                              |
|------------------------------------|
| <b>99,51</b>                       |
| Stati Uniti 99,51                  |
| Canada 0,00                        |
| America Latina e Centrale 0,00     |
| <b>0,48</b>                        |
| Regno Unito 0,00                   |
| Europa Occidentale - Euro 0,01     |
| Europa Occidentale - Non Euro 0,47 |
| Europa dell'Est 0,00               |
| Africa 0,00                        |
| Medio Oriente 0,00                 |
| <b>0,01</b>                        |
| Giappone 0,00                      |
| Australasia 0,00                   |
| Asia - Paesi Sviluppati 0,00       |
| Asia - Emergenti 0,01              |

## Anagrafica

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

| Patrimonio Classe (Mln) | 0,09 USD    |
|-------------------------|-------------|
| (29/01/2026)            |             |
| Domicilio               | LUSSEMBURGO |
| Valuta del Fondo        | USD         |
| UCITS                   | Si          |
| Inc/Acc                 | Inc         |

|                              |       |
|------------------------------|-------|
| Investimento Min. Ingresso   | -     |
| Investimento Min. Successivo | -     |
| T.E.R.                       | 2,20% |
| Spese correnti               | 2,23% |
| Commissione di incentivo     | -     |

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

|                        |              |      |              |
|------------------------|--------------|------|--------------|
| Data Inizio Gestione   | 18/09/2017   | ISIN | LU1956131509 |
| NAV (29/01/2026)       | USD 164,22   |      |              |
| Patrimonio Netto (Mln) | 1.423,29 USD |      |              |
| (31/12/2025)           |              |      |              |