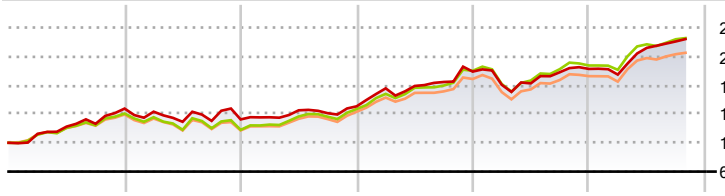
# BNP Paribas Funds Responsible US Multi-Factor Equity Classic USD Inc

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Azionari USA Large Cap Blend | Morningstar US Large-Mid Cap Market NR USD<br>Usato nel Report | S&P 500 NR USD | ★★★ |

## 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 have their registered offices 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 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...

## Rendimenti




| | 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| Fondo | 41,52 | -9,30 | 12,42 | 29,21 | 1,77 | 19,09 |
| Benchmark e Indici | 35,50 | -14,63 | 21,97 | 32,89 | 3,41 | 17,16 |
| Categoria | 34,61 | -14,29 | 20,03 | 29,09 | 2,06 | 15,60 |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -1,66 | 3Y Sharpe Ratio | 1,17 |
| 3Y Beta | 0,98 | 3Y Std Dev | 13,40 |
| 3Y R-Squared | 89,53 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,58 | 5Y Risk | -Med |
| 3Y Tracking Error | 4,20 | 10Y Risk | - |

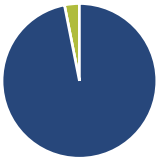
Basati su Morningstar US Large-Mid Cap Market NR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | -0,61 | 0,45 | -0,46 |
| 6-Mesi | 11,30 | 7,80 | 7,13 |
| 1-Anno | 18,37 | 16,64 | 14,53 |
| 3-Anni Ann.ti | 17,59 | 19,65 | 17,15 |
| 5-Anni Ann.ti | 10,76 | 11,33 | 10,04 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 09/11/2026

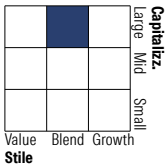
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | -3,66 | 17,76 | 3,63 | - |
| 2025 | -8,58 | 0,98 | 7,88 | 2,19 |
| 2024 | 15,10 | 1,75 | 2,86 | 7,26 |
| 2023 | 2,04 | 6,46 | -2,52 | 6,17 |
| 2022 | -2,64 | -8,94 | 0,90 | 1,40 |

## Portafoglio 30/09/2026



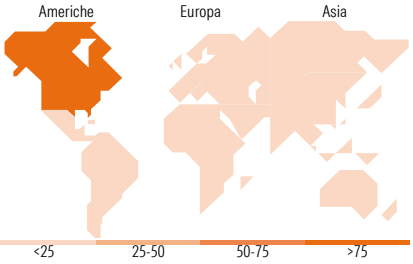
| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 103,32 |
| Obbligazioni | 0,00 |
| Liquidità | -3,32 |
| Altro | 0,00 |

**Style Box Azionaria**




| Mkt Cap % | Fondo |
|---|---|
| Giant | 34,37 |
| Large | 27,59 |
| Medium | 34,59 |
| Small | 3,45 |
| Micro | 0,00 |

| Capitalizzazione media di mercato | Fondo |
|---|---|
| Ave Mkt Cap USD | 293.039,50 |




### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| NVIDIA Corp | | 9,44 |
| Apple Inc | | 7,22 |
| Microsoft Corp | | 5,11 |
| E-mini S&P 500 Future Dec 26 | — | 4,03 |
| Micron Technology Inc | | 2,52 |
| Johnson & Johnson | | 2,42 |
| Broadcom Inc | | 2,20 |
| Amazon.com Inc | | 1,93 |
| Mastercard Inc Class A | | 1,90 |
| Alphabet Inc Class A | | 1,82 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 38,58 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 99 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 0 |

| Distribuzione Settoriale % | Fondo |
|---|---|
| **Ciclico** | **32,05** |
| Materie Prime | 1,87 |
| Beni di Consumo Ciclici | 12,19 |
| Finanza | 17,54 |
| Immobiliare | 0,44 |
| **Sensibile** | **52,08** |
| Telecomunicazioni | 3,28 |
| Energia | 0,13 |
| Beni Industriali | 5,96 |
| Tecnologia | 42,71 |
| **Difensivo** | **15,88** |
| Beni Difensivi | 2,68 |
| Salute | 13,12 |
| Servizi di Pubblica Utilità | 0,07 |

| Ripartizione Geografica % | Fondo |
|---|---|
| **America** | **99,98** |
| Stati Uniti | 99,98 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| **Europa** | **0,01** |
| Regno Unito | 0,00 |
| Europa Occidentale - Euro | 0,00 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,01 |
| Europa dell'Est | 0,00 |
| 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 |

## Anagrafica

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| Società di Gestione | BNP Paribas Asset Management Luxembourg | Patrimonio Classe (Mln) (09/11/2026) | 13,49 USD | Investimento Min. Ingresso | - |
| Telefono | - | Domicilio | LUSSEMBURGO | Investimento Min. Successivo | - |
| Web | - | Valuta del Fondo | USD | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 27/09/2019 | UCITS | Si | Spese correnti | 1,48% |
| Nome del Gestore | Henri Fournier | Inc/Acc | Inc | 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.

# BNP Paribas Funds Responsible US Multi-Factor Equity Classic USD Inc

| | | | |
|---|---|---|---|
| | Wadii El Moujil | ISIN | LU1956163296 |
| Data Inizio Gestione | 27/09/2019 | | |
| NAV (09/11/2026) | USD 228,31 | | |
| Patrimonio Netto (MIn) (30/09/2026) | 1.527,18 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.