## **BNP Paribas Funds Responsible US Value Multi-Factor Equity ClassicR**

Categoria Morningstar™

Azionari USA Large Cap Value

#### **Benchmark Morningstar**

Usato nel Report

Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD

#### **Benchmark Dichiarato**

MSCI USA Value NR USD

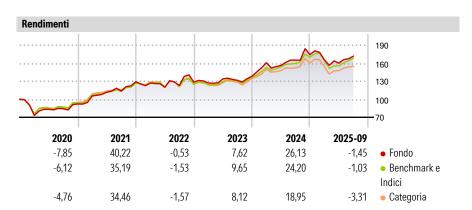
Morningstar Rating™

\*\*\*

### **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...

Misure di Rischio				
3Y Alpha	-1,07	3Y Sharpe Ratio	0,61	
3Y Beta	1,12	3Y Std Dev	15,56	
3Y R-Squared	89,74	3Y Risk	+Med	
3Y Info Ratio	0,03	5Y Risk	+Med	
3Y Tracking Error	5,27	10Y Risk	-	
Basati su Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD (dove applicabile)				



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,86	6,26	2,61	Trimestrali %				
6-Mesi	11,65	14,13	11,14	2025	-4,99	-3,33	7,30	-
1-Anno	3,05	4,73	-0,78	2024	16,39	-2,87	5,69	5,56
3-Anni Ann.ti	7,94	9,09	5,74	2023	-1,06	5,32	-1,78	5,15
5-Anni Ann.ti	16,00	15,38	13,64	2022	-1,66	-5,49	2,36	4,55
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2021	14,60	5,93	1,71	13,56
Rendimenti aggiornati al 29/10/2	2025							

#### Portafoglio 31/08/2025

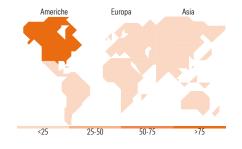




Mkt Cap %	Fondo
Giant	12,23
Large	30,51
Medium	54,63
Small	2,63
Micro	0,00



Ave Mkt Cap USD 71.720,1



Titoli principali		
Nome	Settore	%
E-mini S&P 500 Future Sept 25	_	7,85
Pfizer Inc	•	2,83
Bank of New York Mellon Corp	<b>#</b>	2,31
Bristol-Myers Squibb Co	•	2,27
Gilead Sciences Inc		2,26
Allstate Corp	<b>P</b>	2,18
The Hartford Insurance Group	ugga 🚅	2,13
T. Rowe Price Group Inc		2,08
Expeditors International of	<b>⇔</b>	2,05
Arch Capital Group Ltd		2,05
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		28,02
Numero Complessivo di Titoli Aziona	ri	88
Numero Complessivo di Titoli Obbliga	zionari	0

Distribuzione Settoriale %	Fondo
<b>%</b> Ciclico	39,11
🚣 Materie Prime	2,84
🕰 Beni di Consumo Ciclici	9,94
🚅 Finanza	26,18
<u></u> Immobiliare	0,15
₩ Sensibile	33,54
Telecomunicazioni	2,32
<b>∆</b> Energia	0,22
Beni Industriali	12,39
Tecnologia	18,60
→ Difensivo	27,36
🔚 Beni Difensivi	3,95
🔁 Salute	23,23
Servizi di Pubblica Utilità	0,17

Ripartizione Geografica %	Fondo		
America	98,94		
Stati Uniti	98,94		
Canada	0,00		
America Latina e Centrale	0,00		
Europa	1,06		
Regno Unito	0,00		
Europa Occidentale - Euro	0,01		
Europa Occidentale - Non Euro	1,05		
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		

Patrimonio Classe (MIn) 41,07 USD (29/10/2025)

Domicilio LUSSEMBURGO Valuta del Fondo USD UCITS Si Inc/Acc Acc

Investimento Min. Ingresso Investimento Min. Successivo T.E.R. Spese correnti 1,47%
Commissione di incentivo -

# **BNP Paribas Funds Responsible US Value Multi-Factor Equity ClassicR**

12/02/2024 LU1458427785 Data Inizio Gestione

USD 234,65 NAV (29/10/2025) 1.206,34 USD Patrimonio Netto (MIn)

(31/08/2025)

