

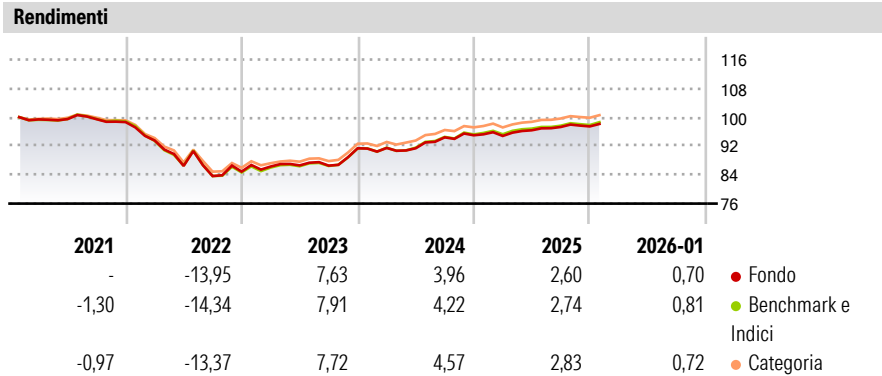
BNP Paribas Funds Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond N Capitalisation

<b>Categoria Morningstar™</b>	<b>Benchmark Morningstar</b>	<b>Benchmark Dichiarato</b>	<b>Morningstar Rating™</b>
Obbligazionari Corporate EUR	Morningstar Eurozone Corporate Bond GR	ICE BofA Euro Corporate TR EUR	★★
	EUR		
	Usato nel Report		

**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

The implemented strategy aims at increasing the value of a portfolio of euro denominated corporate bonds, issued primarily by socially responsible companies, over the medium term using a systematic security selection approach combining several factor styles. This sub-fund invests at least 2/3 of its assets in Investment Grade corporate bonds denominated in EUR and/or securities treated as equivalent. In the event the rating criteria are no longer met, the Investment Manager will promptly adjust the composition of the portfolio in the interest of the shareholders.

Misure di Rischio			
3Y Alpha	-0,29	3Y Sharpe Ratio	0,38
3Y Beta	0,98	3Y Std Dev	3,25
3Y R-Squared	99,30	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-1,17	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	0,28	10Y Risk	-
Basati su Morningstar Eurozone Corporate Bond GR EUR (dove applicabile)			



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	0,11	0,22	0,30	2026	-	-	-	-
6-Mesi	1,18	1,32	1,36	2025	-0,19	1,64	0,97	0,16
1-Anno	2,96	3,05	3,23	2024	0,11	-0,10	3,32	0,61
3-Anni Ann.ti	3,71	3,99	4,43	2023	1,68	0,36	-0,08	5,56
5-Anni Ann.ti	-0,39	-0,30	0,10	2022	-5,18	-7,55	-3,27	1,49
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 02/02/2026

**Portafoglio 31/12/2025**

Asset Allocation %	Netta
Azioni	0,00
Obbligazioni	117,27
Liquidità	-17,28
Altro	0,00

**Fixed Income Style Box™**

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Duration Effettiva			
Maturità effettiva			
Qualità Credito Media			
Sensibilità ai Tassi	Bassa	Med	Alta

Fondo	Credit Quality %	Fond	Credit Quality %	Fond
-	0	-	0	-

Titoli principali			Fixed Income Sector Weightings %		Fondo	Scadenze %		Fondo
Nome	Settore	%						
Euro Bobl Future Mar 26	—	2,25	■ Governativo		-0,79	da 1 a 3		18,35
BNP Paribas Mois ISR IC	—	1,11	■ Societario		98,11	da 3 a 5		41,41
Banco BPM S.p.A. 6%	—	0,95	■ Cartolarizzazioni		0,00	da 5 a 7		14,17
Aena SME S.A. 4.25%	—	0,88	■ Enti Locali		0,00	da 7 a 10		15,26
Covestro AG 4.75%	—	0,87	■ Liquidità ed equivalenti		-17,29	da 10 a 15		8,09
Klepierre SA 0.625%	—	0,87	■ Derivati		19,96	da 15 a 20		0,00
Danone SA 3.481%	—	0,87				da 20 a 30		0,00
Koninklijke KPN N.V. 3.875%	—	0,86				oltre 30		0,00
Danone SA 3.706%	—	0,86						
Iberdrola Finanzas S.A.U....	—	0,85						
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		10,37						
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0						
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		150						

Anagrafica			
Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg	Patrimonio Classe (Mln)	0,35 EUR
Telefono	+352 2646 3017	(02/02/2026)	
Web	www.bnpparibas-am.com	Domicilio	LUSSEMBURGO
Data di Partenza	30/01/2018	Valuta del Fondo	EUR
Nome del Gestore	Clement Georges	UCITS	Si
Data Inizio Gestione	22/04/2024	Inc/Acc	Acc
NAV (02/02/2026)	EUR 97,83	ISIN	LU1664648547
Patrimonio Netto (Mln)	72,39 EUR		
(31/12/2025)			
		Investimento Min. Ingresso	-
		Investimento Min. Successivo	-
		T.E.R.	0,66%
		Spese correnti	0,68%
		Commissione di incentivo	-