

# BNP Paribas Funds Sustainable Euro Multi-Factor Corporate Bond I Capitalisation

**Categoria Morningstar™**

Obbligazionari Corporate EUR

**Benchmark Morningstar**

Morningstar Eurozone Corporate Bond GR

EUR

Usato nel Report

**Benchmark Dichiarato**

ICE BofA Euro Corporate TR EUR

**Morningstar Rating™**

★★★

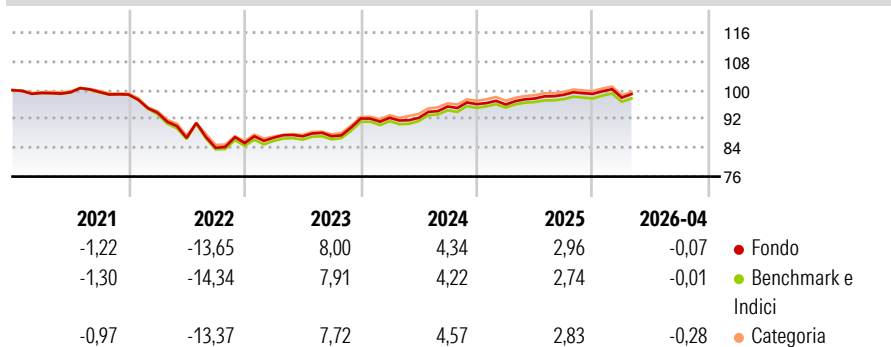
**Obiettivo d'Investimento Dichiarato**

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	0,07	3Y Sharpe Ratio	0,36
3Y Beta	1,00	3Y Std Dev	3,46
3Y R-Squared	99,41	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	0,25	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	0,26	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Eurozone Corporate Bond GR EUR (dove applicabile)

**Rendimenti**


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,81	-1,25	-0,97	2026	-1,05	-	-	-
6-Mesi	-0,07	-0,43	-0,21	2025	-0,11	1,73	1,06	0,25
1-Anno	2,32	1,88	1,96	2024	0,21	-0,02	3,43	0,69
3-Anni Ann.ti	4,12	3,98	4,31	2023	1,76	0,45	0,01	5,65
5-Anni Ann.ti	0,02	-0,26	0,00	2022	-5,10	-7,47	-3,18	1,57
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 11/05/2026

**Portafoglio 31/03/2026**


Asset Allocation %	Netta
● Azioni	0,00
● Obbligazioni	120,94
● Liquidità	-20,94
● Altro	0,00

**Fixed Income Style**
**Box™**

Qualità Credito	Alto	Med	Basso
Duration Effettiva			
Maturità effettiva			
Qualità Credito Media			

Sensibilità ai Tassi

**Fondo**
**Credit Quality %**
**Fond**
**Credit Quality %**
**Fond**
**Credit Quality %**
**Fond**
**Credit Quality %**
**Fond**
**Titoli principali**

Nome	Settore	%
Euro Bobl Future June 26	—	2,26
Euro Buxl Future June 26	—	1,28
Banco BPM S.p.A. 4.875%	—	1,11
Intesa Sanpaolo S.p.A. 5.625%	—	1,11
UniCredit S.p.A. 4.45%	—	1,09
Al Sydbank AS 3%	—	1,00
Essity Capital B.V. 0.25%	—	1,00
Vattenfall AB 0.125%	—	1,00
DH Europe Finance II SARL...	—	0,99
Banco BPM S.p.A. 6%	—	0,99
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		11,83
Numero Complessivo di Titoli Azionari		0
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		138

**Fixed Income Sector Weightings %**

	Fondo
🏛️ Governativo	-0,12
🏢 Societario	98,74
🏠 Cartolarizzazioni	0,00
🏘️ Enti Locali	0,00
🏦 Liquidità ed equivalenti	-20,94
📄 Derivati	22,32

**Coupon Range %**

	Fondo
0 coupon	0,87
Da 0 a 4 cedole	73,14
Da 4 a 6 cedole	24,37
Da 6 a 8 cedole	1,63
Da 8 a 10 cedole	0,00
Da 10 a 12 cedole	0,00
Oltre 12 cedole	0,00

**Scadenze %**

	Fondo
da 1 a 3	22,49
da 3 a 5	18,79
da 5 a 7	36,94
da 7 a 10	12,81
da 10 a 15	5,27
da 15 a 20	0,00
da 20 a 30	0,00
oltre 30	0,00

**Anagrafica**

Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg	Patrimonio Classe (Mln)	16,99 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 2646 3017	Domicilio	LUSSEMBURGO	Investimento Min. Successivo	-
Web	www.bnpparibas-am.com	Valuta del Fondo	EUR	T.E.R.	-
Data di Partenza	24/01/2018	UCITS	Si	Spese correnti	0,31%
Nome del Gestore	Clement Georges	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	22/04/2024	ISIN	LU1664648976		
NAV <sup>(11/05/2026)</sup>	EUR 106,84				
Patrimonio Netto (Mln)	50,57 EUR				

(31/03/2026)