

BNP Paribas Funds Sustainable Europe Multi-Factor Equity N EUR Capitalisation

Categoria Morningstar™

Azione Europa Large Cap Blend

Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Target
Market Exposure NR EUR
Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

MSCI Europe NR EUR

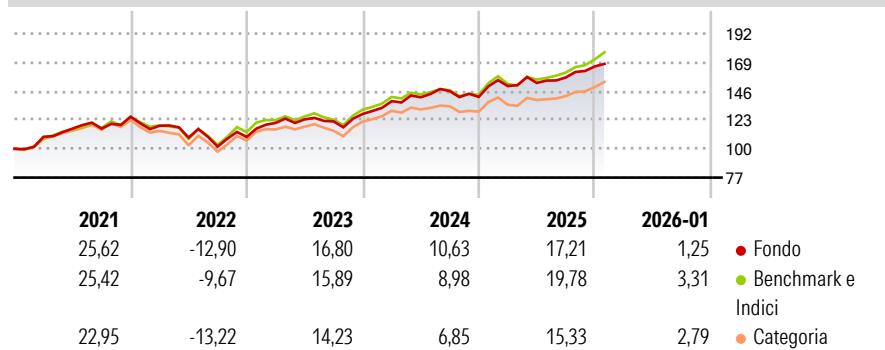
Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The implemented strategy aims at increasing the value of a portfolio of European 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 Europe. 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 assets may be...

Rendimenti



Misure di Rischio

3Y Alpha	0,23	3Y Sharpe Ratio	1,10
3Y Beta	0,93	3Y Std Dev	8,83
3Y R-Squared	90,16	3Y Risk	-Med
3Y Info Ratio	-0,17	5Y Risk	-Med
3Y Tracking Error	2,84	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Developed Europe Target Market Exposure NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %

Mese	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	10,71	12,18	11,25
6-Mesi	10,60	13,27	10,85
1-Anno	14,20	16,68	13,22
3-Anni Ann.ti	13,98	14,39	11,86
5-Anni Ann.ti	11,24	11,96	10,15
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 24/02/2026

Rendimenti Trimestrali %

Q1	Q2	Q3	Q4	
2026	-	-	-	
2025	6,15	1,64	2,84	5,63
2024	7,99	2,24	3,49	-3,18
2023	10,27	2,35	-1,32	4,88
2022	-5,76	-7,98	-6,59	7,54

Portafoglio 31/12/2025



Asset Allocation %	Netta
Azioni	106,40
Obbligazioni	0,00
Liquidità	-8,04
Altro	1,63

Style Box Azionaria

Stile	Capitalizz.		
	Large	Mid	Small
Value	■	■	■
Blend	■	■	■
Growth	■	■	■

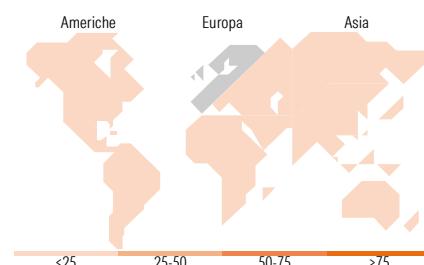
Mkt Cap %

Fondo
Giant
Large
Medium
Small
Micro

Capitalizzazione media di mercato

Fondo
Ave Mkt Cap EUR 54.051,5

6



Titoli principali

Nome	Settore	%
MSCI Europe Index Net Total...	-	9,24
ASML Holding NV	■	4,64
Novartis AG Registered Shares	■	3,43
AstraZeneca PLC	■	3,01
Allianz SE	■	2,79
Banco Bilbao Vizcaya...	■	2,53
ABB Ltd	■	2,38
Deutsche Telekom AG	■	2,37
UniCredit SpA	■	2,33
Zurich Insurance Group AG	■	2,29
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		35,02
Numeri Complessivo di Titoli Azionari		94
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %

Fondo
Ciclico 36,17
Materie Prime 1,27
Beni di Consumo Ciclici 5,33
Finanza 29,57
Immobiliare -
Sensibile 36,57
Telecomunicazioni 8,21
Energia -
Beni Industriali 18,59
Tecnologia 9,78
Difensivo 27,26
Beni Difensivi 9,42
Salute 15,97
Servizi di Pubblica Utilità 1,86

Ripartizione Geografica %

Fondo
America 1,33
Stati Uniti 0,27
Canada 0,00
America Latina e Centrale 1,06
Europa 98,67
Regno Unito 24,62
Europa Occidentale - Euro 53,02
Europa Occidentale - Non Euro 21,03
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 - Emergenti 0,00

Anagrafica

Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg	Patrimonio Classe (Mln)	5,74 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
Telefono	+352 2646 3017	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	2,23%
Web	www.bnpparibas-am.com	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	2,73%
Data di Partenza	13/09/2019	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	Jean-Baptiste Simoen	Inc/Acc	Acc		

BNP Paribas Funds Sustainable Europe Multi-Factor Equity N EUR Capitalisation

Data Inizio Gestione	15/12/2022	ISIN	LU1956135674
NAV (24/02/2026)	EUR 167,71		
Patrimonio Netto (Mln)	828,44 EUR		
(31/12/2025)			