## **BNP Paribas Funds Responsible US Multi-Factor Equity N USD Acc**

Categoria Morningstar™

Azionari USA Large Cap Blend

### **Benchmark Morningstar**

Morningstar US Large-Mid Cap NR USD

#### **Benchmark Dichiarato**

S&P 500 NR USD

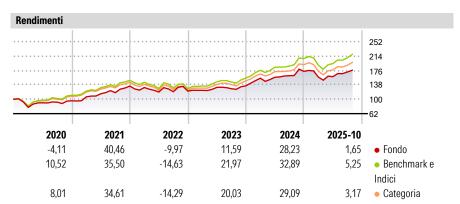
Morningstar Rating™

 $\star\star$ 

#### **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...

| Misure di Rischio  | )     |                 |       |
|--|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha   | -4,96 | 3Y Sharpe Ratio | 0,56  |
| 3Y Beta  | 0,98  | 3Y Std Dev      | 14,06 |
| 3Y R-Squared   | 91,05 | 3Y Risk         | +Med  |
| 3Y Info Ratio  | -1,52 | 5Y Risk         | Med   |
| 3Y Tracking Error  | 4,05  | 10Y Risk        | -     |
| Basati su Morningstar US Large-Mid Cap NR USD (dove applicabile) |       |                 |       |



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti    |
|------------------|-------|-------|-------|---------------|
| 3-Mesi           | 5,19  | 10,35 | 5,69  | Trimestrali % |
| 6-Mesi           | 17,45 | 19,58 | 20,26 | 2025          |
| 1-Anno           | 8,57  | 13,91 | 10,52 | 2024          |
| 3-Anni Ann.ti    | 10,31 | 17,35 | 14,21 | 2023          |
| 5-Anni Ann.ti    | 14,75 | 16,40 | 15,51 | 2022          |
| 10-Anni Ann.ti   | =     | -     | -     | 2021          |

## Portafoglio 30/09/2025





Rendimenti aggiornati al 31/10/2025

| Mkt Cap %        | Fondo |
|------------------|-------|
| Giant            | 32,24 |
| Large            | 29,43 |
| Medium           | 36,38 |
| Small            | 1,95  |
| Micro            | 0,00  |
| Capitalizzazione | Fondo |



| Americhe | Eu    | ropa  | Asia |
|----------|-------|-------|------|
|          |       |       |      |
| <25      | 25-50 | 50-75 | >75  |

Q1

-8,75

14,90

1,85

-2,82

10,71

Q2

0,79

1,56

6,26

-9,10

7,69

Q3

7,67

2,66

-2,71

0,71

2,64 14,78

Q4

7,05

5,97

1,20

| Titoli principali                     |          |       |
|---------------------------------------|----------|-------|
| Nome                                  | Settore  | %     |
| E-mini S&P 500 Future Dec 25          | _        | 9,56  |
| NVIDIA Corp                           |          | 8,49  |
| Microsoft Corp                        |          | 6,59  |
| Apple Inc                             |          | 4,86  |
| Visa Inc Class A                      | <b>L</b> | 2,44  |
| Broadcom Inc                          |          | 2,34  |
| Alphabet Inc Class A                  |          | 2,04  |
| Pfizer Inc                            | +        | 1,84  |
| Progressive Corp                      |          | 1,79  |
| Gilead Sciences Inc                   |          | 1,72  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio      |          | 41,66 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari |          |       |
| Numero Complessivo di Titoli Obbliga  | azionari | 0     |

Anagrafica

| Distribuzione Settoriale %  | Fondo |
|-----------------------------|-------|
| <b>♦</b> Ciclico            | 30,81 |
| 🚣 Materie Prime             | 2,24  |
| 🕰 Beni di Consumo Ciclici   | 8,96  |
| 🚅 Finanza                   | 19,44 |
|                             | 0,17  |
| ₩ Sensibile                 | 50,25 |
| Telecomunicazioni           | 6,54  |
| <b>Tenergia</b>             | 0,25  |
| 🔯 Beni Industriali          | 7,97  |
| Tecnologia                  | 35,48 |
| → Difensivo                 | 18,94 |
| 🔚 Beni Difensivi            | 4,50  |
| ■ Salute                    | 14,23 |
| Servizi di Pubblica Utilità | 0,21  |

| Ripartizione Geografica %     | Fondo |
|-------------------------------|-------|
| America                       | 99,96 |
| Stati Uniti                   | 99,96 |
| Canada                        | 0,00  |
| America Latina e Centrale     | 0,00  |
| Europa                        | 0,04  |
| Regno Unito                   | 0,00  |
| Europa Occidentale - Euro     | 0,01  |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,02  |
| 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  |
|                               |       |

| Società di Gestione | BNP Paribas Asset<br>Management Luxembourg | Patrimonio Classe (MIn) | 10,08 USD   | Investimento Min. Ingresso<br>Investimento Min. Successi |
|---------------------|--|-------------------------|-------------|--|
| Telefono            | +352 2646 3017                             | Domicilio               | LUSSEMBURGO | T.E.R.   |
| Web                 | www.bnpparibas-am.com                      | Valuta del Fondo        | USD         | Spese correnti   |
| Data di Partenza    | 27/09/2019                                 | UCITS                   | Si          | Commissione di incentivo                                 |

 Nome del Gestore
 Inc/Acc
 Acc

 Data Inizio Gestione
 27/09/2019
 ISIN
 LU1956163619

| Investimento Min. Ingresso   | -     |
|------------------------------|-------|
| Investimento Min. Successivo | =     |
| T.E.R.                       | =     |
| Spese correnti               | 2,21% |
|                              |       |

# **BNP Paribas Funds Responsible US Multi-Factor Equity N USD Acc**

NAV (31/10/2025) USD 193,85 Patrimonio Netto (MIn) 1.561,49 USD

(30/09/2025)

