

# BNP Paribas Funds Sustainable Euro Multi-Factor Equity I Capitalisation

**Categoria Morningstar™**  
Azione Area Euro Large Cap

**Benchmark Morningstar**  
Morningstar Developed Eurozone Target  
Market Exposure NR EUR  
Usato nel Report

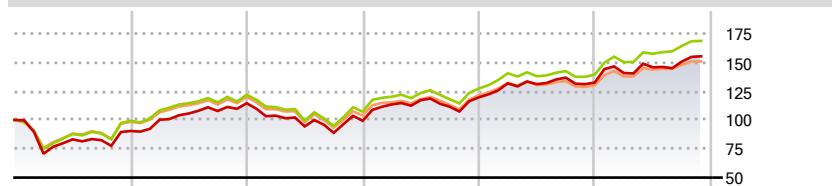
**Benchmark Dichiarato**  
MSCI EMU NR EUR

**Morningstar Rating™**  
★★★

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The implemented strategy aims at increasing the value of a portfolio of euro 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 in the Eurozone. The remaining portion, namely a maximum 25% of its assets, may be invested in other equities, debt securities, money market instruments, and 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 invested in UCITS or UCIs.

## Rendimenti



2020	2021	2022	2023	2024	2025-11
-9,55	26,58	-13,27	20,46	10,74	17,20
-0,75	22,74	-12,03	18,73	9,54	20,95
-1,69	21,90	-13,63	16,95	7,18	16,09

## Misure di Rischio

3Y Alpha	-1,02	3Y Sharpe Ratio	0,92
3Y Beta	1,06	3Y Std Dev	12,26
3Y R-Squared	95,97	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,20	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	2,55	10Y Risk	-

Basato su Morningstar Developed Eurozone Target Market Exposure NREUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	7,10	5,72	4,57
6-Mesi	9,62	11,28	7,14
1-Anno	18,28	23,66	17,77
3-Anni Ann.ti	16,84	16,89	14,16
5-Anni Ann.ti	11,90	11,63	9,46
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 18/12/2025

Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	6,25	3,52	3,38	-
2024	10,11	-0,47	4,32	-3,13
2023	14,28	3,33	-4,94	7,31
2022	-9,39	-8,96	-5,93	11,76
2021	10,80	5,39	2,05	6,22

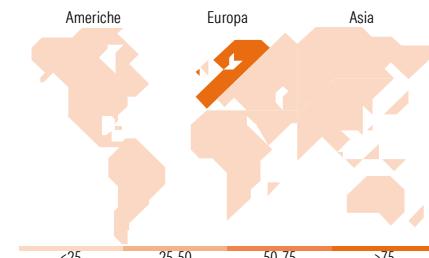
## Portafoglio 31/10/2025



Asset Allocation %	Netta
• Azioni	100,00
• Obbligazioni	0,00
• Liquidità	0,00
• Altro	0,00

Style Box Azionaria	Mkt Cap %	Fondo
Capitalizz.	Giant	66,30
Large	25,66	
Medium	8,05	
Small	0,00	
Value	Micro	0,00
Blend		
Growth		

Capitalizzazione media di mercato	Fondo
Ave Mkt Cap EUR	72.318,0



## Titoli principali

Nome	Settore	%
ASML Holding NV	☐	9,28
Schneider Electric SE	⚙️	5,07
Allianz SE	🕒	5,01
Sanofi SA	✚	4,77
UniCredit SpA	🕒	4,60
Intesa Sanpaolo	🕒	4,45
Siemens Energy AG Ordinary...	⚙️	4,32
Deutsche Telekom AG	📠	4,30
AXA SA	🕒	3,96
Munchener...	🕒	3,85
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		49,62
Numeri Complessivo di Titoli Azionari		53
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

## Distribuzione Settoriale %

Fondo
● Ciclico
■ Materie Prime
● Beni di Consumo Ciclici
■ Finanza
■ Immobiliare
▼ Sensibile
■ Telecomunicazioni
■ Energia
■ Beni Industriali
■ Tecnologia
► Difensivo
■ Beni Difensivi
■ Salute
■ Servizi di Pubblica Utilità

## Ripartizione Geografica %

Fondo
● America
■ Stati Uniti
■ Canada
■ America Latina e Centrale
■ Europa
■ Regno Unito
■ Europa Occidentale - Euro
■ Europa Occidentale - Non Euro
■ Europa dell'Est
■ Africa
■ Medio Oriente
■ Asia
■ Giappone
■ Australasia
■ Asia - Paesi Sviluppati
■ Asia - Emergenti

## Anagrafica

Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg	Patrimonio Classe (Mln)	6,16 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.	0,61%
Data di Partenza	18/09/2019	UCITS	Si	Spese correnti	0,61%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc	Commissione di incentivo	-

## BNP Paribas Funds Sustainable Euro Multi-Factor Equity I Capitalisation

Data Inizio Gestione	18/09/2019	ISIN	LU1920355549
NAV (18/12/2025)	EUR 166,01		
Patrimonio Netto (Mln)	26,70 EUR		
(31/10/2025)			