

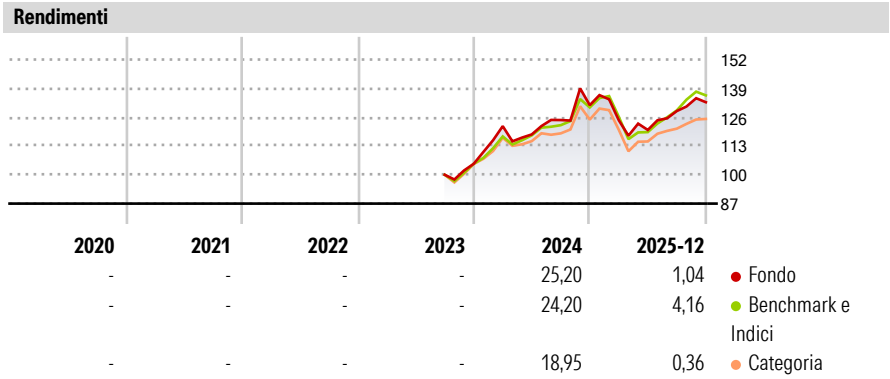
BNP Paribas Funds Responsible US Value Multi-Factor Equity N EUR

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Azionari USA Large Cap Value	Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD Usato nel Report	MSCI USA Value NR USD	Senza rating

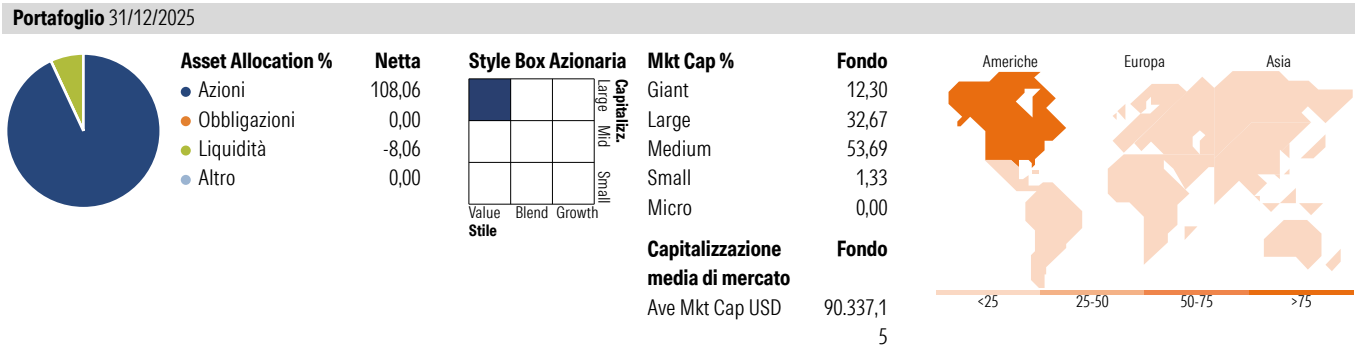
Obiettivo d'Investimento Dichiarato

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 the management team considers to be under-valued as compared to the market on the purchase date and that have their registered office 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, money market instruments and provided...

Misure di Rischio			
3Y Alpha	- 3Y Sharpe Ratio	-	
3Y Beta	- 3Y Std Dev	-	
3Y R-Squared	- 3Y Risk	-	
3Y Info Ratio	- 5Y Risk	-	
3Y Tracking Error	- 10Y Risk	-	
Basati su Morningstar US Large-Mid Cap Broad Value NR USD (dove applicabile)			



Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,92	2,15	3,97	Trimestrali %				
6-Mesi	7,73	11,07	6,88	2026	-	-	-	-
1-Anno	-1,06	1,61	-1,90	2025	-5,17	-3,52	7,11	3,10
3-Anni Ann.ti	-	-	-	2024	16,18	-3,05	5,49	5,37
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2023	-	-	-	4,95
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	-	-	-	-
Rendimenti aggiornati al 29/01/2026								



Titoli principali		
Nome	Settore	%
E-mini S&P 500 Future Mar 26	—	9,04
Johnson & Johnson	+	2,46
Pfizer Inc	+	2,41
Gilead Sciences Inc	+	2,31
Bank of New York Mellon Corp	+	2,28
Newmont Corp	+	2,20
TJX Companies Inc	+	2,19
NVIDIA Corp	+	2,17
Arch Capital Group Ltd	+	2,16
Allstate Corp	+	2,16
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		29,37
Numero Complessivo di Titoli Azionari		83
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		0

Distribuzione Settoriale %		Fondo
Ciclico		38,88
Materie Prime		3,43
Beni di Consumo Ciclici		11,36
Finanza		23,94
Immobiliare		0,15
Sensibile		28,97
Telecomunicazioni		2,08
Energia		0,23
Beni Industriali		6,54
Tecnologia		20,12
Difensivo		32,15
Beni Difensivi		3,40
Salute		28,56
Servizi di Pubblica Utilità		0,19

Ripartizione Geografica %		Fondo
America		99,51
Stati Uniti		99,51
Canada		0,00
America Latina e Centrale		0,00
Europa		0,48
Regno Unito		0,00
Europa Occidentale - Euro		0,01
Europa Occidentale - Non Euro		0,47
Europa dell'Est		0,00
Africa		0,00
Medio Oriente		0,00
Asia		0,01
Giappone		0,00
Australasia		0,00
Asia - Paesi Sviluppati		0,00
Asia - Emergente		0,01

Anagrafica					
Società di Gestione	BNP Paribas Asset Management Luxembourg	Patrimonio Classe (Mln)	0,02 EUR	Investimento Min. Ingresso	-
		(29/01/2026)		Investimento Min. Successivo	-
Telefono	+352 2646 3017	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	-
Web	www.bnpparibas-am.com	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	-
Data di Partenza	15/09/2023	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Nome del Gestore	Wadii El Moujil	Inc/Acc	Acc		

BNP Paribas Funds Responsible US Value Multi-Factor Equity N EUR

Data Inizio Gestione	18/09/2017	ISIN	LU2572686918
NAV <small>(29/01/2026)</small>	EUR 192,05		
Patrimonio Netto (Mln)	1.423,29 USD		
<small>(31/12/2025)</small>			