

# BNP Paribas Funds Sustainable Europe Value N Capitalisation

## Categoria Morningstar™

Azionari Europa Large Cap Value

## Benchmark Morningstar

Morningstar Developed Europe Value

Target Market Exposure NR EUR

Usato nel Report

## Benchmark Dichiarato

MSCI Europe Value NR EUR

## Morningstar Rating™

★★★

### Obiettivo d'Investimento Dichiarato

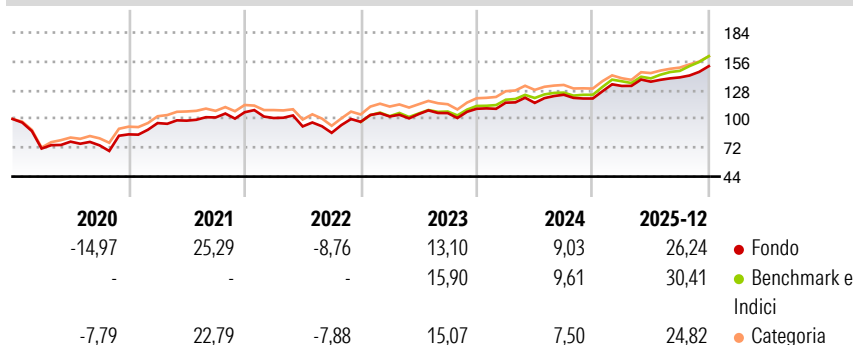
Il comparto investe almeno il 75% del patrimonio in titoli azionari emessi da società che, a giudizio del team di gestione, sono sottovalutate rispetto al mercato alla data di acquisto e che hanno sede legale in uno stato membro del SEE, diverso da stati che non collaborano alla lotta contro le frodi e l'evasione fiscale. Il saldo residuo, ossia massimo il 25% del suo patrimonio, potrà essere investito in altri valori mobiliari, strumenti del mercato monetario, derivati e/o liquidità e, inoltre, entro un limite del 15% del patrimonio, in strumenti di debito di qualsivoglia tipo e, entro un limite del 10% del patrimonio, in OICVM o OIC.

### Misure di Rischio

|                   |       |                 |       |
|-------------------|-------|-----------------|-------|
| 3Y Alpha          | -2,53 | 3Y Sharpe Ratio | 1,19  |
| 3Y Beta           | 1,03  | 3Y Std Dev      | 10,38 |
| 3Y R-Squared      | 93,52 | 3Y Risk         | Med   |
| 3Y Info Ratio     | -0,91 | 5Y Risk         | Med   |
| 3Y Tracking Error | 2,67  | 10Y Risk        | Med   |

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

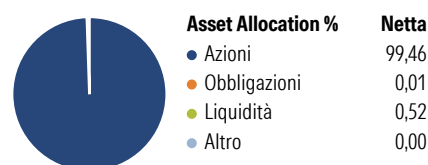
### Rendimenti



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk   | Cat   | Rendimenti Trimestrali % | Q1    | Q2    | Q3    | Q4    |
|------------------|-------|-------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi           | 7,57  | 10,24 | 9,02  | 2026                     | -     | -     | -     | -     |
| 6-Mesi           | 11,05 | 16,68 | 13,08 | 2026                     | 10,21 | 3,14  | 3,07  | 7,75  |
| 1-Anno           | 21,97 | 27,24 | 22,94 | 2025                     | 5,36  | -0,17 | 6,86  | -2,99 |
| 3-Anni Ann.ti    | 13,77 | 17,17 | 14,72 | 2024                     | 5,38  | 2,26  | 0,93  | 3,99  |
| 5-Anni Ann.ti    | 12,67 | 15,95 | 13,75 | 2023                     | -5,26 | -8,11 | -6,69 | 12,31 |
| 10-Anni Ann.ti   | 5,43  | 9,39  | 8,07  | 2022                     |       |       |       |       |

Rendimenti aggiornati al 29/01/2026

### Portafoglio 31/12/2025



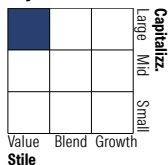
#### Asset Allocation %

- Azioni
- Obbligazioni
- Liquidità
- Altro

#### Netta

99,46  
0,01  
0,52  
0,00

#### Style Box Azionaria

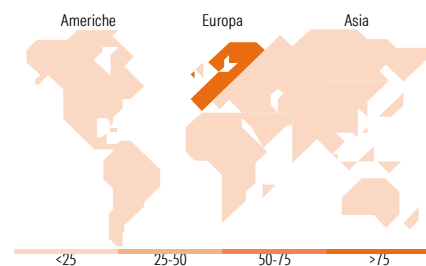


#### Mkt Cap %

| Fondo  |
|--------|
| Giant  |
| Large  |
| Medium |
| Small  |
| Micro  |

#### Capitalizzazione media di mercato

Ave Mkt Cap EUR 66.344,28



| Titoli principali                           |         |       |
|---|---------|-------|
| Nome  | Settore | %     |
| HSBC Holdings PLC                           |         | 5,69  |
| Roche Holding AG                            |         | 5,50  |
| Allianz SE                                  |         | 4,32  |
| Iberdrola SA                                |         | 4,01  |
| Banco Bilbao Vizcaya...                     |         | 3,61  |
| Banco Santander SA                          |         | 3,44  |
| ING Groep NV                                |         | 3,07  |
| Siemens AG                                  |         | 3,01  |
| Intesa Sanpaolo                             |         | 2,98  |
| Unilever PLC                                |         | 2,98  |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio            |         | 38,61 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari       |         | 63    |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari |         | 0     |

| Distribuzione Settoriale % |                             | Fondo        |
|----------------------------|-----------------------------|--------------|
|                            | <b>Ciclico</b>              | <b>53,60</b> |
|                            | Materie Prime               | 5,53         |
|                            | Beni di Consumo Ciclici     | 4,72         |
|                            | Finanza                     | 42,67        |
|                            | Immobiliare                 | 0,67         |
|                            | <b>Sensibile</b>            | <b>16,22</b> |
|                            | Telecomunicazioni           | 4,37         |
|                            | Energia                     | -            |
|                            | Beni Industriali            | 7,81         |
|                            | Tecnologia                  | 4,05         |
|                            | <b>Difensivo</b>            | <b>30,19</b> |
|                            | Beni Difensivi              | 8,34         |
|                            | Salute                      | 12,14        |
|                            | Servizi di Pubblica Utilità | 9,71         |

| Ripartizione Geografica %     |  | Fondo        |
|-------------------------------|--|--------------|
| <b>America</b>                |  | <b>0,00</b>  |
| Stati Uniti                   |  | 0,00         |
| Canada                        |  | 0,00         |
| America Latina e Centrale     |  | 0,00         |
| <b>Europa</b>                 |  | <b>99,32</b> |
| Regno Unito                   |  | 14,73        |
| Europa Occidentale - Euro     |  | 73,23        |
| Europa Occidentale - Non Euro |  | 11,35        |
| Europa dell'Est               |  | 0,00         |
| Africa                        |  | 0,00         |
| Medio Oriente                 |  | 0,00         |
| <b>Asia</b>                   |  | <b>0,68</b>  |
| Giappone                      |  | 0,00         |
| Australasia                   |  | 0,00         |
| Asia - Paesi Sviluppati       |  | 0,68         |
| Asia - Emergente              |  | 0,00         |

### Anagrafica

|                      |   |                         |              |                              |       |
|----------------------|---|-------------------------|--------------|------------------------------|-------|
| Società di Gestione  | BNP Paribas Asset Management Luxembourg | Patrimonio Classe (Mln) | 3,07 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.                       | 2,73% |
| Data di Partenza     | 02/10/2003                              | UCITS                   | Si           | Spese correnti               | 2,73% |
| Nome del Gestore     | Sabine Jorrot                           | Inc/Acc                 | Acc          | Commissione di incentivo     | -     |
| Data Inizio Gestione | 01/04/2021                              | ISIN                    | LU0177332573 |                              |       |
| NAV (29/01/2026)     | EUR 231,00                              |                         |              |                              |       |

# BNP Paribas Funds Sustainable Europe Value N Capitalisation

|                        |            |
|------------------------|------------|
| Patrimonio Netto (Mln) | 337,89 EUR |
| (31/12/2025)           |            |