

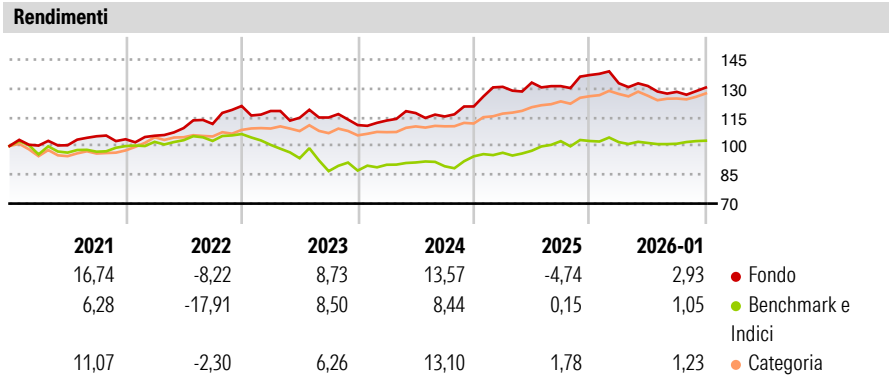
BlackRock Strategic Funds - European Absolute Return Fund D2 GBP Hedged

| | | | |
|-------------------------------|---|-----------------------------|----------------------------|
| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
| Category_EUCA001020 | Morningstar UK Cautious Target Allocation | Euribor 3 Month EUR | ★★ |
| | NR GBP | | |
| | Usato nel Report | | |

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il Comparto tenderà di guadagnare almeno il 70% della sua esposizione mediante azioni e titoli correlati ad azioni (ivi compresi derivati) emessi da, o che forniscano un'esposizione a, società aventi sede o che svolgano una parte preponderante della loro attività economica in Europa. Il Comparto tenderà di conseguire questo obiettivo investendo almeno il 70% del suo patrimonio complessivo in azioni e titoli correlati ad azioni e, ove opportuno, in liquidità e strumenti finanziari assimilabili.

| Misure di Rischio | | | |
|---|------|-----------------|------|
| 3Y Alpha | 1,53 | 3Y Sharpe Ratio | 0,54 |
| 3Y Beta | 0,16 | 3Y Std Dev | 7,11 |
| 3Y R-Squared | 1,39 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | 0,26 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 6,51 | 10Y Risk | Med |
| Basati su Morningstar UK Cautious Target Allocation NR GBP (dove applicabile) | | | |



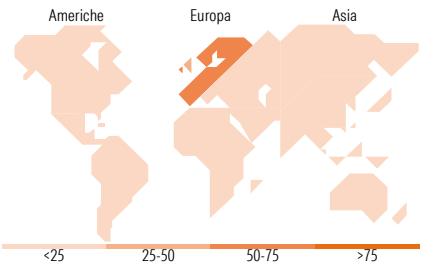
| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|------|-------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | 5,03 | 2,46 | 5,15 | 2026 | - | - | - | - |
| 6-Mesi | 5,04 | 3,45 | 6,53 | 2025 | -3,11 | -1,07 | -2,34 | 1,76 |
| 1-Anno | -3,38 | 1,27 | 3,96 | 2024 | 8,48 | 1,70 | -1,39 | 4,39 |
| 3-Anni Ann.ti | 7,44 | 5,39 | 10,36 | 2023 | 2,13 | 3,43 | -1,53 | 4,53 |
| 5-Anni Ann.ti | 5,06 | 0,64 | 7,15 | 2022 | -2,17 | -2,98 | 0,13 | -3,43 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,41 | 0,98 | 3,26 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 04/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



| Fixed Income Style Box™ | | Fondo |
|-------------------------|----------------|-------|
| Duration Effettiva | | - |
| Maturity effettiva | | - |
| Qualità Credito Media | | - |
| Qualità Credito | Alto Med Basso | |
| Sensibilità ai Tassi | Bassa Med Alta | |



| Titoli principali | | |
|---|--------------|-------|
| Nome | Settore | % |
| MTU Aero Engines AG | Aviazione | 2,77 |
| Lloyds Banking Group PLC | Banca | 2,68 |
| ABN AMRO Bank NV | Banca | 2,37 |
| Lonza Group Ltd | Chimica | 2,27 |
| Blk Ics Eur As Liq... | Liquidità | 2,23 |
| Rolls-Royce Holdings PLC | Aviazione | 2,21 |
| Sandvik AB | Industria | 2,16 |
| Umicore SA Ordinary Shares | Chimica | 2,15 |
| AstraZeneca PLC | Farmaceutico | 2,08 |
| Novonesis (Novozymes) B... | Farmaceutico | 2,07 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 23,00 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 118 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 0 |

| Fixed Income Sector Weightings % | | Fondo |
|----------------------------------|--|-------|
| Governativo | | 0,00 |
| Societario | | 0,08 |
| Cartolarizzazioni | | 0,00 |
| Enti Locali | | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | | 99,99 |
| Derivati | | -0,07 |
| Coupon Range % | | Fondo |
| 0 coupon | | 15,81 |
| Da 0 a 4 cedole | | 84,19 |
| Da 4 a 6 cedole | | 0,00 |
| Da 6 a 8 cedole | | 0,00 |
| Da 8 a 10 cedole | | 0,00 |
| Da 10 a 12 cedole | | 0,00 |
| Oltre 12 cedole | | 0,00 |

| Ripartizione Geografica % | | Fondo |
|-------------------------------|--|-------|
| America | | 2,24 |
| Stati Uniti | | 2,24 |
| Canada | | 0,00 |
| America Latina e Centrale | | 0,00 |
| Europa | | 97,76 |
| Regno Unito | | 26,74 |
| Europa Occidentale - Euro | | 46,15 |
| Europa Occidentale - Non Euro | | 24,88 |
| 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 |

Anagrafica

| | | | | | |
|------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------|------------------------------|-------------|
| Società di Gestione | BlackRock (Luxembourg) SA | Patrimonio Classe (Mln) | 1,48 GBP | Investimento Min. Ingresso | 100.000 USD |
| Telefono | +44 20 77433000 | (04/02/2026) | | Investimento Min. Successivo | 1.000 USD |
| Web | www.blackrock.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 25/07/2012 | Valuta del Fondo | GBP | Spese correnti | 1,37% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | 20,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/07/2013 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (04/02/2026) | GBP 200,25 | ISIN | LU0802637750 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 562,77 EUR | | | | |

(31/12/2025)