BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund E2 EUR

Categoria Morningstar™
Alt - Equity Hedged - Market Neutral

Benchmark Morningstar
Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR
Usato nel Report

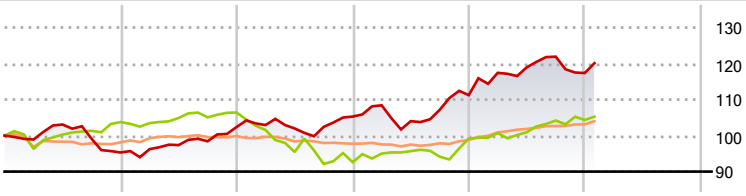
Benchmark Dichiarato
SOFR 3 month USD

Morningstar Rating™
★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

Il Comparto tenterà 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 costituite o quotate negli Stati Uniti, in Canada e America Latina (le "Americhe"). Il Comparto tenterà 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. Il Comparto sarà fortemente diversificato tra tutte le azioni delle Americhe, pur cercando di minimizzare l'esposizione netta ai mercati azionari sottostanti della regione.

Rendimenti



	2020	2021	2022	2023	2024	2025-01
Fondo	-4,69	7,44	2,81	5,66	5,52	2,33
Benchmark e Indici	3,75	2,55	-12,96	7,12	5,19	0,87
Categoria	-0,90	1,98	-1,70	1,70	4,79	0,86

Misure di Rischio

3Y Alpha	2,51	3Y Sharpe Ratio	0,43
3Y Beta	-0,05	3Y Std Dev	6,20
3Y R-Squared	0,28	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	0,51	5Y Risk	Med
3Y Tracking Error	9,01	10Y Risk	-

Basati su Morningstar Euro Cautious Global Target Allocation NR EUR (dove applicabile)

Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,68	1,41	2,46
6-Mesi	-1,59	2,27	3,97
1-Anno	5,01	6,68	7,45
3-Anni Ann.ti	5,18	1,00	5,89
5-Anni Ann.ti	3,82	0,64	5,70
10-Anni Ann.ti	-	-	-

Rendimenti aggiornati al 21/02/2025

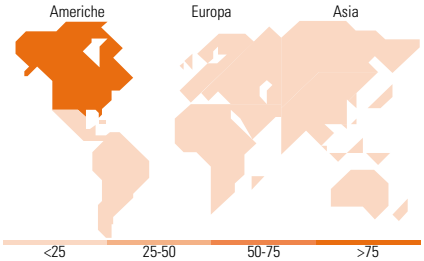
Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
2025	-	-	-	-
2024	5,58	1,29	2,49	-3,73
2023	2,98	-4,06	3,04	3,79
2022	0,52	-0,93	0,44	2,79
2021	0,98	1,16	1,09	4,04

Portafoglio 31/01/2025

Asset Allocation %	Netta
Azioni	8,87
Obbligazioni	3,12
Liquidità	88,01
Altro	0,00

Fixed Income Style Box™

	Fondo
Duration Effettiva	-
Maturity effettiva	-
Qualità Credito Media	



Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	—	2,28
CFD on Brown & Brown Inc	—	2,04
United States Treasury Bills...	—	1,99
CFD on Packaging Corp of...	—	1,97
CFD on Colgate-Palmolive Co	—	1,86
CFD on Citizens Financial...	—	1,64
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		11,78
Numero Complessivo di Titoli Azionari		3.972
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		4

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
Governativo	19,48
Societario	0,64
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	79,87
Derivati	0,00

Coupon Range %	Fondo
0 coupon	100,00
Da 0 a 4 cedole	0,00
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	**99,14**
Stati Uniti	98,45
Canada	0,26
America Latina e Centrale	0,43
Europa	**0,72**
Regno Unito	0,36
Europa Occidentale - Euro	0,07
Europa Occidentale - Non Euro	0,25
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,02
Medio Oriente	0,02
Asia	**0,14**
Giappone	0,00
Australasia	0,00
Asia - Paesi Sviluppati	0,08
Asia - Emergente	0,06

Anagrafica

Società di Gestione	BlackRock (Luxembourg) SA
Telefono	+44 20 77433000
Web	www.blackrock.com
Data di Partenza	29/07/2015
Nome del Gestore	-
Data Inizio Gestione	17/02/2012
NAV (21/02/2025)	EUR 115,94
Patrimonio Classe (Mln) (21/02/2025)	5,92 EUR
Domicilio	LUSSEMBURGO
Valuta del Fondo	EUR
UCITS	Si
Inc/Acc	Acc
ISIN	LU1266592614
Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Investimento Min. Successivo	-
T.E.R.	2,95%
Spese correnti	2,55%
Commissione di incentivo	20,00%

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.

BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund E2 EUR Hedged

Patrimonio Netto (Mln) 1.021,59 USD
(31-01-25)

© 2025 Morningstar Italia. Tutti i diritti sono riservati. Le informazioni qui contenute: (1) sono proprietà di Morningstar, (2) non possono essere copiate, (3) non costituiscono consiglio di investimento; (4) sono fornite con scopi informativi; (5) sono ritenute attendibili da Morningstar che, pertanto, ne garantisce il maggior grado di accuratezza e completezza possibile, fatto salvo il caso in cui queste Le siano state fornite in modo errato e/o non completo dalle relative società prodotto; (6) sono estratte dai dati del fondo disponibili e riferiti a date temporali diverse. Morningstar non è responsabile per qualunque danno o perdita derivante da qualunque uso delle informazioni e chi visiona tali informazioni sarà responsabile dell'uso che andrà a farne. Non vi è naturalmente garanzia alcuna che i risultati del passato trovino un riscontro nel futuro.