

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

Categoria Morningstar™  
**Hedged**  
Market Neutral

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

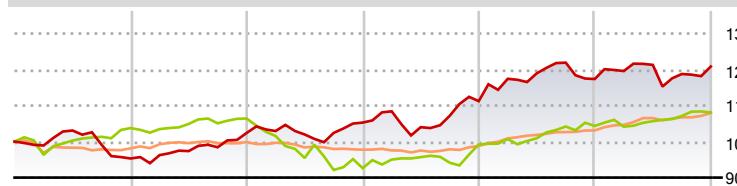
Benchmark Dichiarato  
SOFR 3 month USD

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	2025-12
-4,69	7,44	2,81	5,66	5,52	2,97
3,75	2,55	-12,96	7,12	5,19	3,58
-0,90	1,98	-1,70	1,70	4,79	4,82

## Misure di Rischio

3Y Alpha	1,93	3Y Sharpe Ratio	0,28
3Y Beta	-0,03	3Y Std Dev	6,70
3Y R-Squared	0,03	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,07	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	7,86	10Y Risk	+Med

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

## Rend. Cumulati %

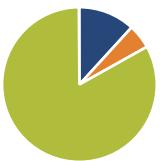
	Fondo	Bmk	Cat
3-Mesi	1,48	0,94	2,92
6-Mesi	0,69	3,40	4,21
1-Anno	-2,37	4,50	5,88
3-Anni Ann.ti	4,22	4,76	6,87
5-Anni Ann.ti	4,55	0,97	5,38
10-Anni Ann.ti	1,26	2,21	3,04

Rendimenti aggiornati al 16/01/2026

## Rendimenti

	Q1	Q2	Q3	Q4
2026	-	-	-	-
2025	1,89	1,43	-2,09	1,76
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

## Portafoglio 30/11/2025



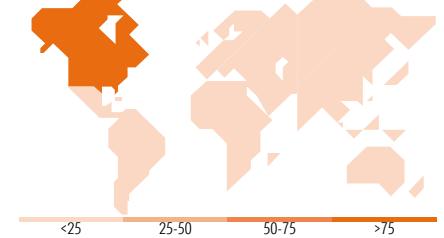
### Asset Allocation %

	Netta
Azioni	11,78
Obbligazioni	5,11
Liquidità	82,99
Altro	0,12

### Fixed Income Style

Box™	Duration Effettiva	Fondo
Alto	Maturity effettiva	-
Med	Qualità Credito Media	-
Basso	Sensibilità ai Tassi	-

### Rendimenti Trimestrali %



## Titoli principali

Nome	Settore	%
United States Treasury Bills...	-	3,13
United States Treasury Bills...	-	2,80
United States Treasury Bills...	-	2,70
United States Treasury Bills...	-	2,68
United States Treasury Bills...	-	2,21
United States Treasury Bills...	-	1,76
Bristol-Myers Squibb Co	+	1,74
United States Treasury Bills...	-	1,65
Cullen/Frost Bankers Inc	+	1,62
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio		20,28
Numeri Complessivi di Titoli Azionari		4,098
Numeri Complessivi di Titoli Obbligazionari		6

### Fixed Income Sector Weightings %

	Fondo
Governativo	29,36
Societario	0,57
Cartolarizzazioni	0,00
Enti Locali	0,00
Liquidità ed equivalenti	70,07
Derivati	0,00

### Ripartizione Geografica %

	Fondo
<b>America</b>	<b>98,38</b>
Stati Uniti	97,02
Canada	0,31
America Latina e Centrale	1,05
<b>Europa</b>	<b>1,17</b>
Regno Unito	0,12
Europa Occidentale - Euro	0,24
Europa Occidentale - Non Euro	0,56
Europa dell'Est	0,00
Africa	0,04
Medio Oriente	0,20
<b>Asia</b>	<b>0,46</b>
Giappone	0,00
Australasia	0,07
Asia - Paesi Sviluppati	0,14
Asia - Emergenti	0,25

## Anagrafica

Società di Gestione	BlackRock (Luxembourg) SA	Patrimonio Classe (Mln) (16/01/2026)	7,92 EUR	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	+44 20 77433000	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	2,69%
Web	www.blackrock.com	Valuta del Fondo	EUR	Spese correnti	2,55%
Data di Partenza	29/07/2015	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	17/02/2012	ISIN	LU1266592614		
NAV (16/01/2026)	EUR 114,14				

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

Patrimonio Netto (Mln)  
**Hedged**

1.593,70 USD