

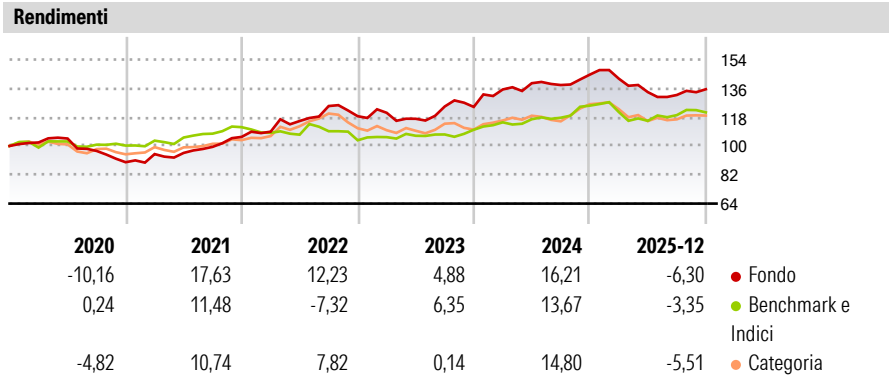
BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund I2 USD

Categoria Morningstar™	Benchmark Morningstar	Benchmark Dichiarato	Morningstar Rating™
Category_EUCA001004	Morningstar US Conservative Target	SOFR 3 month USD	★★★★
	Allocation NR USD		
	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 costituite o quotate negli Stati Uniti, in Canada e America Latina (le "Americhe"). 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. Il Comparto sarà fortemente diversificato tra tutte le azioni delle Americhe, pur cercando di minimizzare l'esposizione netta ai mercati azionari sottostanti della regione.

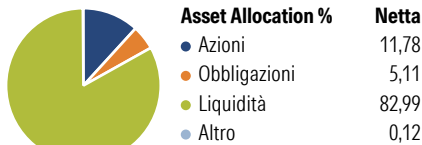
Misure di Rischio			
3Y Alpha	2,78	3Y Sharpe Ratio	0,22
3Y Beta	0,05	3Y Std Dev	8,52
3Y R-Squared	0,21	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,10	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	8,41	10Y Risk	-
Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)			



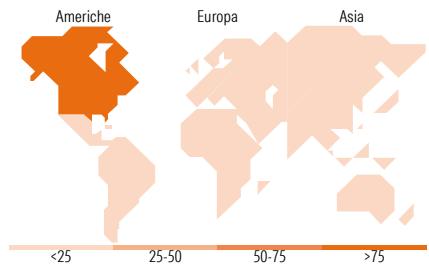
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	3,11	2,21	4,14	2026	-	-	-	-
6-Mesi	2,54	5,72	5,32	2026	-1,72	-5,93	-1,34	2,72
1-Anno	-10,29	-2,27	-3,75	2025	8,77	2,90	-0,82	4,69
3-Anni Ann.ti	4,92	5,49	6,80	2024	1,79	-3,09	6,55	-0,21
5-Anni Ann.ti	8,27	4,03	8,75	2023	3,09	6,10	8,10	-5,08
10-Anni Ann.ti	-	-	-	2022				

Rendimenti aggiornati al 16/01/2026

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style			Fondo	
Box™			Duration Effettiva	-
		Qualità Credito	Maturità effettiva	-
			Qualità Credito Media	
Bassa	Med	Alta		
Sensibilità ai Tassi				



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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		4.098
Numero Complessivo 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
Coupon Range %		Fondo
0 coupon		90,42
Da 0 a 4 cedole		0,00
Da 4 a 6 cedole		7,20
Da 6 a 8 cedole		2,38
Da 8 a 10 cedole		0,00
Da 10 a 12 cedole		0,00
Oltre 12 cedole		0,00

Ripartizione Geografica %		Fondo
America		98,38
Stati Uniti		97,02
Canada		0,31
America Latina e Centrale		1,05
Europa		1,17
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
Asia		0,46
Giappone		0,00
Australasia		0,07
Asia - Paesi Sviluppati		0,14
Asia - Emergente		0,25

Anagrafica					
Società di Gestione	BlackRock (Luxembourg) SA	Patrimonio Classe (Mln)	24,87 USD	Investimento Min. Ingresso	10.000.000 USD
		(16/01/2026)		Investimento Min. Successivo	1.000 USD
Telefono	+44 20 77433000	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,62%
Web	www.blackrock.com	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,13%
Data di Partenza	02/08/2017	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc		
Data Inizio Gestione	17/02/2012	ISIN	LU1653088168		
NAV (16/01/2026)	USD 147,48				

BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund I2 USD

Patrimonio Netto (Mln)	1.593,70 USD
(30/11/2025)	