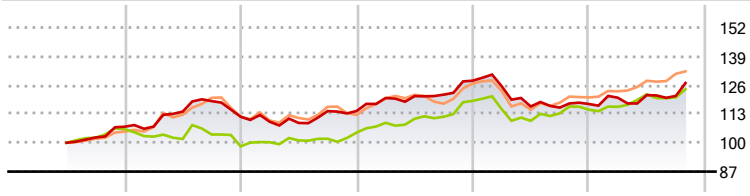
# BlackRock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy Fund D USD Acc

| Categoria Morningstar™ | Benchmark Morningstar | Benchmark Dichiarato | Morningstar Rating™ |
|---|---|---|---|
| Category_EUCA001010 | Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD<br>Usato nel Report | ICE BofA 0-3 M US Trsy Bill TR USD | ★★★ |

## Obiettivo d'Investimento Dichiarato

The investment objective of the fund is to provide a total return in the form of capital and income. The Fund seeks to achieve its objective by investing globally in equity securities, fixed income securities, instruments relating to such securities (namely total return swaps, credit default swaps, interest rate swaps, currency swaps, options, futures, options on futures and forwards and the securities referred to below), shares or units of CIS, money market instruments, deposits, foreign currencies and cash, along with any other securities or instruments.

## Rendimenti




| 2021 | 2022 | 2023 | 2024 | 2025 | 2026-10 | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| - | 4,19 | 2,35 | 11,95 | -8,22 | 8,04 | Fondo |
| - | -7,32 | 6,35 | 13,67 | -3,35 | 8,02 | Benchmark e Indici |
| - | 7,54 | 0,91 | 13,92 | -4,44 | 9,97 | Categoria |

## Misure di Rischio

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3Y Alpha | -1,77 | 3Y Sharpe Ratio | 0,16 |
| 3Y Beta | 0,61 | 3Y Std Dev | 7,18 |
| 3Y R-Squared | 46,71 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,93 | 5Y Risk | Med |
| 3Y Tracking Error | 4,04 | 10Y Risk | - |

Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)

| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat |
|---|---|---|---|
| 3-Mesi | 5,62 | 2,84 | 4,60 |
| 6-Mesi | 9,62 | 5,94 | 9,07 |
| 1-Anno | 8,71 | 8,58 | 14,55 |
| 3-Anni Ann.ti | 4,08 | 7,10 | 7,76 |
| 5-Anni Ann.ti | 4,09 | 3,47 | 9,21 |
| 10-Anni Ann.ti | - | - | - |

Rendimenti aggiornati al 13/11/2026

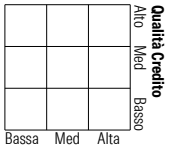
| Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|---|---|---|---|---|
| 2026 | 2,40 | 1,00 | -0,33 | - |
| 2025 | -1,99 | -7,26 | -0,44 | 1,42 |
| 2024 | 5,10 | 0,71 | 0,55 | 5,19 |
| 2023 | -2,02 | -0,49 | 4,92 | 0,06 |
| 2022 | 0,06 | 6,26 | 4,17 | -5,93 |

## Portafoglio 30/09/2026

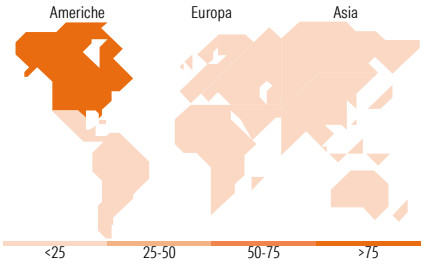


| Asset Allocation % | Netta |
|---|---|
| Azioni | 15,48 |
| Obbligazioni | 103,09 |
| Liquidità | 3,27 |
| Altro | -21,84 |

**Fixed Income Style Box™**




| Fondo | |
|---|---|
| Duration Effettiva | 1,97 |
| Maturity effettiva | 3,71 |
| Qualità Credito Media | |




### Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---|---|
| United States Treasury Bills | — | 4,24 |
| United States Treasury Bills | — | 3,57 |
| United States Treasury Bills | — | 3,09 |
| United States Treasury Bills | — | 1,52 |
| Federal National Mortgage... | — | 1,47 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 13,90 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 547 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 1.177 |

| Fixed Income Sector Weightings % | Fondo |
|---|---|
| Governativo | 14,39 |
| Societario | 49,59 |
| Cartolarizzazioni | 33,03 |
| Enti Locali | 0,00 |
| Liquidità ed equivalenti | 7,68 |
| Derivati | -4,68 |

| Coupon Range % | Fondo |
|---|---|
| 0 coupon | 12,59 |
| Da 0 a 4 cedole | 17,30 |
| Da 4 a 6 cedole | 36,25 |
| Da 6 a 8 cedole | 15,07 |
| Da 8 a 10 cedole | 13,12 |
| Da 10 a 12 cedole | 2,68 |
| Oltre 12 cedole | 2,99 |

| Ripartizione Geografica % | Fondo |
|---|---|
| **America** | **99,88** |
| Stati Uniti | 96,77 |
| Canada | 3,11 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| **Europa** | **0,12** |
| Regno Unito | 0,09 |
| Europa Occidentale - Euro | 0,01 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 0,02 |
| 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 Asset Management Ireland Ltd |
| Telefono | - |
| Web | www.blackrock.com |
| Data di Partenza | 14/06/2021 |
| Nome del Gestore | - |
| Data Inizio Gestione | - |
| NAV (13/11/2026) | USD 119,44 |
| Patrimonio Netto (Mln) (30/09/2026) | 156,35 USD |
| Patrimonio Classe (Mln) (13/11/2026) | 4,51 USD |
| Domicilio | IRLANDA |
| Valuta del Fondo | USD |
| UCITS | Si |
| Inc/Acc | Acc |
| ISIN | IE00BKPSQG65 |
| Investimento Min. Ingresso | 5.000 USD |
| Investimento Min. Successivo | 1.000 USD |
| T.E.R. | - |
| Spese correnti | 0,90% |
| Commissione di incentivo | - |

See disclosures for more details

© 2026 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.

MORNINGSTAR