

BlackRock Strategic Funds - European Absolute Return Fund I2 EUR

Categoria Morningstar™

Alt - Azionario Market Neutral

Benchmark Morningstar

Morningstar Euro Cautious Global Target

Allocation NR EUR

Usato nel Report

Benchmark Dichiarato

Euribor 3 Month EUR

Morningstar Rating™

★★★

Obiettivo d'Investimento Dichiarato

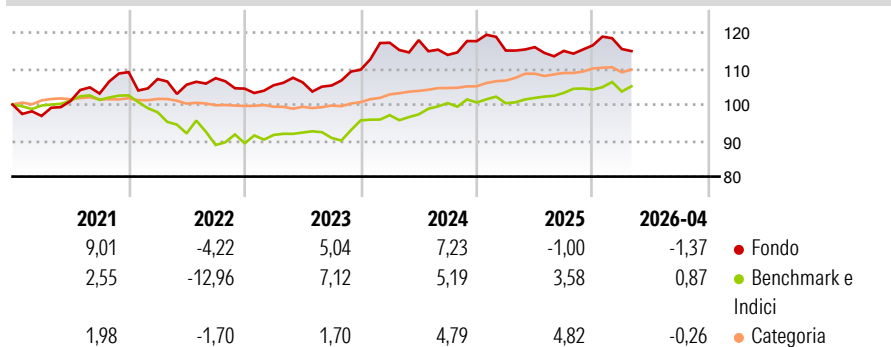
Il Comparto tenderà di guadagnare almeno il 70% della sua esposizione mediante azioni e titoli correlati ad azioni (ivi compresi derivati) emessi da, o che forniscano un'esposizione a, società aventi sede o che svolgano una parte preponderante della loro attività economica in Europa. Il Comparto tenderà 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 | -0,72 | 3Y Sharpe Ratio | -0,02 |
| 3Y Beta | 0,38 | 3Y Std Dev | 5,83 |
| 3Y R-Squared | 7,53 | 3Y Risk | Med |
| 3Y Info Ratio | -0,31 | 5Y Risk | +Med |
| 3Y Tracking Error | 6,12 | 10Y Risk | Med |

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

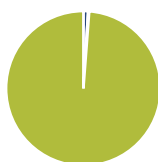
Rendimenti



| Rend. Cumulati % | Fondo | Bmk | Cat | Rendimenti Trimestrali % | Q1 | Q2 | Q3 | Q4 |
|------------------|-------|-------|------|--------------------------|-------|-------|-------|-------|
| 3-Mesi | -1,23 | -0,14 | 0,38 | 2026 | -0,87 | - | - | - |
| 6-Mesi | 0,11 | 0,61 | 2,04 | 2025 | -2,22 | 0,82 | -0,90 | 1,34 |
| 1-Anno | 0,37 | 4,22 | 3,65 | 2024 | 6,83 | 0,62 | -3,49 | 3,36 |
| 3-Anni Ann.ti | 2,48 | 4,56 | 6,69 | 2023 | 0,90 | 0,77 | -0,82 | 4,16 |
| 5-Anni Ann.ti | 3,25 | 1,13 | 4,75 | 2022 | -1,77 | -1,47 | 1,71 | -2,70 |
| 10-Anni Ann.ti | 2,66 | 1,97 | 3,53 | | | | | |

Rendimenti aggiornati al 12/05/2026

Portafoglio 31/03/2026



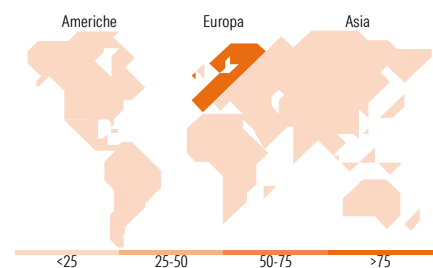
| Asset Allocation % | Netta |
|--------------------|-------|
| Azioni | 0,98 |
| Obbligazioni | 0,22 |
| Liquidità | 98,79 |
| Altro | 0,00 |

Fixed Income Style

Box™

| Qualità Credito | Alto | Med | Basso |
|----------------------|-------|-----|-------|
| Sensibilità ai Tassi | Bassa | Med | Alta |

| Fondo | |
|-----------------------|---|
| Duration Effettiva | - |
| Maturità effettiva | - |
| Qualità Credito Media | - |



Titoli principali

| Nome | Settore | % |
|---|---------|-------|
| Blk Ics Eur As Liq... | - | 7,17 |
| CFD on AstraZeneca PLC | - | 1,85 |
| Novonesis (Novozymes) B... | 🏭 | 1,84 |
| SSE PLC | 💡 | 1,83 |
| Lonza Group Ltd | ⚙️ | 1,83 |
| Engie SA | 💡 | 1,78 |
| UniCredit SpA | 🏦 | 1,61 |
| ABN AMRO Bank NV | 🏦 | 1,60 |
| CFD on Wise PLC Class A | - | 1,60 |
| UCB SA | ⚙️ | 1,59 |
| % Primi 10 Titoli sul Patrimonio | | 22,71 |
| Numero Complessivo di Titoli Azionari | | 108 |
| Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari | | 0 |

Fixed Income Sector Weightings %

| Fondo | |
|----------------------------|-------|
| 🏛️ Governativo | 0,00 |
| ⚙️ Societario | 0,23 |
| 🏠 Cartolarizzazioni | 0,00 |
| 👥 Enti Locali | 0,00 |
| 🏦 Liquidità ed equivalenti | 99,78 |
| 📄 Derivati | -0,01 |

Coupon Range %

| Fondo | |
|-------------------|--------|
| 0 coupon | 0,00 |
| Da 0 a 4 cedole | 100,00 |
| 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 | 1,41 |
| Stati Uniti | 1,41 |
| Canada | 0,00 |
| America Latina e Centrale | 0,00 |
| Europa | 98,59 |
| Regno Unito | 19,03 |
| Europa Occidentale - Euro | 51,71 |
| Europa Occidentale - Non Euro | 27,85 |
| 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) | 103,17 EUR | Investimento Min. Ingresso | 10.000.000 USD |
| Telefono | +44 20 77433000 | (12/05/2026) | | Investimento Min. Successivo | 10.000 USD |
| Web | www.blackrock.com | Domicilio | LUSSEMBURGO | T.E.R. | - |
| Data di Partenza | 30/04/2012 | Valuta del Fondo | EUR | Spese correnti | 1,08% |
| Nome del Gestore | - | UCITS | Si | Commissione di incentivo | 20,00% |
| Data Inizio Gestione | 01/07/2013 | Inc/Acc | Acc | | |
| NAV (12/05/2026) | EUR 177,61 | ISIN | LU0776931064 | | |
| Patrimonio Netto (Mln) | 477,35 EUR | | | | |

(31/03/2026)

© 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 prodotte; (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.