

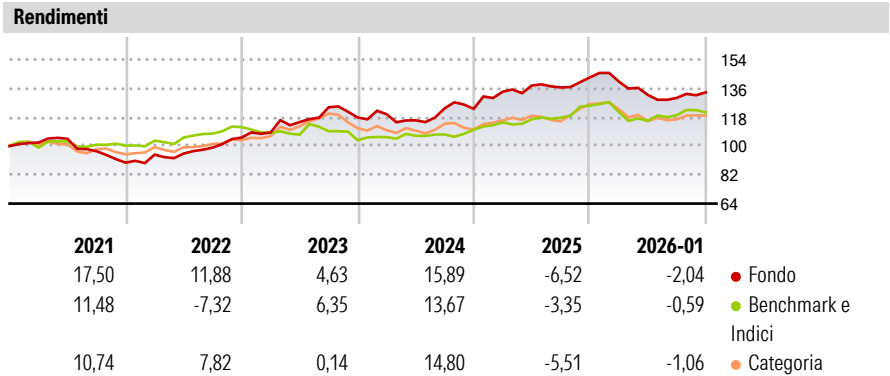
BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund D2 USD

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

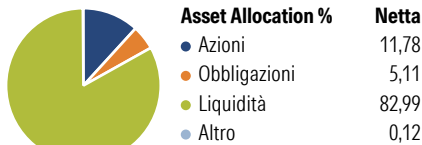
Il Comparto tenderà di guadagnare almeno il 70% della sua esposizione mediante azioni e titoli correlati ad azioni (ivi compresi derivati) emessi da, o che forniscano un'esposizione a, società costituite o quotate negli Stati Uniti, in Canada e America Latina (le "Americhe"). Il Comparto tenderà di conseguire 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	2,08	3Y Sharpe Ratio	0,14
3Y Beta	0,05	3Y Std Dev	8,59
3Y R-Squared	0,18	3Y Risk	+Med
3Y Info Ratio	-0,08	5Y Risk	+Med
3Y Tracking Error	8,33	10Y Risk	Med
Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)			

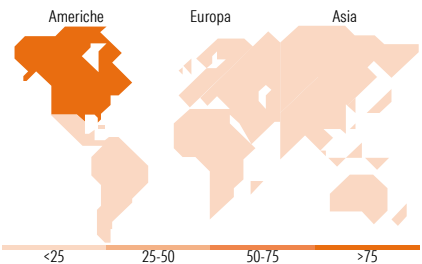


Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,29	-1,31	0,62	2026	-	-	-	-
6-Mesi	2,81	2,55	2,84	2025	-1,78	-5,96	-1,41	2,65
1-Anno	-10,20	-4,65	-5,34	2024	8,70	2,84	-0,88	4,58
3-Anni Ann.ti	4,42	4,59	7,03	2023	1,72	-3,15	6,48	-0,27
5-Anni Ann.ti	7,67	3,48	8,44	2022	3,02	6,00	8,05	-5,18
10-Anni Ann.ti	3,66	4,09	4,66					
Rendimenti aggiornati al 03/02/2026								

Portafoglio 30/11/2025



Fixed Income Style			Fondo	
Box™				
		Qualità Credito	Duration Effettiva	-
			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)	12,28 USD	Investimento Min. Ingresso	100.000 USD
Telefono	+44 20 77433000	(03/02/2026)		Investimento Min. Successivo	1.000 USD
Web	www.blackrock.com	Domicilio	LUSSEMBURGO	T.E.R.	1,75%
Data di Partenza	27/05/2015	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	1,42%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	20,00%
Data Inizio Gestione	17/02/2012	Inc/Acc	Acc		
NAV (03/02/2026)	USD 155,87	ISIN	LU1238068321		

BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund D2 USD

Patrimonio Netto (Mln) 1.593,70 USD

(30/11/2025)