

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 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																																																											
<table border="1"> <thead> <tr> <th>Anno</th> <th>Fondo</th> <th>Benchmark e Indici</th> <th>Categoria</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2021</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2022</td> <td>4,19</td> <td>2,35</td> <td>-7,32</td> </tr> <tr> <td>2023</td> <td>11,95</td> <td>12,65</td> <td>6,35</td> </tr> <tr> <td>2024</td> <td>-8,22</td> <td>12,65</td> <td>13,67</td> </tr> <tr> <td>2025</td> <td>-3,35</td> <td>12,65</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2026-01</td> <td>-0,65</td> <td>12,65</td> <td>-0,59</td> </tr> <tr> <td></td> <td>7,54</td> <td>11,35</td> <td>13,92</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td>-4,44</td> <td>0,49</td> </tr> <tr> <td></td> <td></td> <td></td> <td>0,49</td> </tr> </tbody> </table>				Anno	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria	2021	-	-	-	2022	4,19	2,35	-7,32	2023	11,95	12,65	6,35	2024	-8,22	12,65	13,67	2025	-3,35	12,65	-	2026-01	-0,65	12,65	-0,59		7,54	11,35	13,92			-4,44	0,49				0,49																
Anno	Fondo	Benchmark e Indici	Categoria																																																								
2021	-	-	-																																																								
2022	4,19	2,35	-7,32																																																								
2023	11,95	12,65	6,35																																																								
2024	-8,22	12,65	13,67																																																								
2025	-3,35	12,65	-																																																								
2026-01	-0,65	12,65	-0,59																																																								
	7,54	11,35	13,92																																																								
		-4,44	0,49																																																								
			0,49																																																								
Misure di Rischio																																																											
3Y Alpha	-1,10	3Y Sharpe Ratio	-0,12																																																								
3Y Beta	0,45	3Y Std Dev	6,84																																																								
3Y R-Squared	47,26	3Y Risk	Med																																																								
3Y Info Ratio	-0,67	5Y Risk	-																																																								
3Y Tracking Error	4,03	10Y Risk	-																																																								
Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)																																																											
Portafoglio 31/12/2025																																																											
<table border="1"> <thead> <tr> <th>Categoria</th> <th>Percentuale</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Azioni</td> <td>17,19</td> </tr> <tr> <td>Obbligazioni</td> <td>88,61</td> </tr> <tr> <td>Liquidità</td> <td>-5,87</td> </tr> <tr> <td>Altro</td> <td>0,07</td> </tr> </tbody> </table>				Categoria	Percentuale	Azioni	17,19	Obbligazioni	88,61	Liquidità	-5,87	Altro	0,07																																														
Categoria	Percentuale																																																										
Azioni	17,19																																																										
Obbligazioni	88,61																																																										
Liquidità	-5,87																																																										
Altro	0,07																																																										
Fixed Income Style Box™ <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th></th> <th>Qualità Credito</th> </tr> <tr> <th></th> <th></th> <th>Basso Med Alto</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>Netta</td> <td>17,19</td> <td>Basso</td> </tr> <tr> <td>• Azioni</td> <td>17,19</td> <td>Med</td> </tr> <tr> <td>• Obbligazioni</td> <td>88,61</td> <td>Alto</td> </tr> <tr> <td>• Liquidità</td> <td>-5,87</td> <td>Med</td> </tr> <tr> <td>• Altro</td> <td>0,07</td> <td>Basso</td> </tr> </tbody> </table>				Qualità Credito			Basso Med Alto	Netta	17,19	Basso	• Azioni	17,19	Med	• Obbligazioni	88,61	Alto	• Liquidità	-5,87	Med	• Altro	0,07	Basso	Fixed Income Duration <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>Duration Effettiva</th> <th>Maturity effettiva</th> <th>Qualità Credito Media</th> <th>Fondo</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>3-Mesi</td> <td>-0,01</td> <td>-0,92</td> <td>0,59</td> <td>3,00</td> </tr> <tr> <td>6-Mesi</td> <td>0,50</td> <td>2,83</td> <td>6,40</td> <td>4,23</td> </tr> <tr> <td>1-Anno</td> <td>-9,60</td> <td>-3,82</td> <td>-2,85</td> <td>BBB</td> </tr> <tr> <td>3-Anni Ann.ti</td> <td>2,27</td> <td>4,70</td> <td>6,43</td> <td></td> </tr> <tr> <td>5-Anni Ann.ti</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> <tr> <td>10-Anni Ann.ti</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td></td> </tr> </tbody> </table>			Duration Effettiva	Maturity effettiva	Qualità Credito Media	Fondo	3-Mesi	-0,01	-0,92	0,59	3,00	6-Mesi	0,50	2,83	6,40	4,23	1-Anno	-9,60	-3,82	-2,85	BBB	3-Anni Ann.ti	2,27	4,70	6,43		5-Anni Ann.ti	-	-	-		10-Anni Ann.ti	-	-	-	
		Qualità Credito																																																									
		Basso Med Alto																																																									
Netta	17,19	Basso																																																									
• Azioni	17,19	Med																																																									
• Obbligazioni	88,61	Alto																																																									
• Liquidità	-5,87	Med																																																									
• Altro	0,07	Basso																																																									
	Duration Effettiva	Maturity effettiva	Qualità Credito Media	Fondo																																																							
3-Mesi	-0,01	-0,92	0,59	3,00																																																							
6-Mesi	0,50	2,83	6,40	4,23																																																							
1-Anno	-9,60	-3,82	-2,85	BBB																																																							
3-Anni Ann.ti	2,27	4,70	6,43																																																								
5-Anni Ann.ti	-	-	-																																																								
10-Anni Ann.ti	-	-	-																																																								
Geographic Distribution		Rendimenti Trimestrali % <table border="1"> <thead> <tr> <th>Trimestre</th> <th>Q1</th> <th>Q2</th> <th>Q3</th> <th>Q4</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>2026</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> <td>-</td> </tr> <tr> <td>2025</td> <td>-1,99</td> <td>-7,26</td> <td>-0,44</td> <td>1,42</td> </tr> <tr> <td>2024</td> <td>5,10</td> <td>0,71</td> <td>0,55</td> <td>5,19</td> </tr> <tr> <td>2023</td> <td>-2,02</td> <td>-0,49</td> <td>4,92</td> <td>0,06</td> </tr> <tr> <td>2022</td> <td>0,06</td> <td>6,26</td> <td>4,17</td> <td>-5,93</td> </tr> </tbody> </table>		Trimestre	Q1	Q2	Q3	Q4	2026	-	-	-	-	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																										
Trimestre	Q1	Q2	Q3	Q4																																																							
2026	-	-	-	-																																																							
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																																																							
Titoli principali																																																											
Nome	Settore	%																																																									
iShares Broad \$ HY Corp Bd...	-	6,38																																																									
United States Treasury Bills	-	4,79																																																									
United States Treasury Bills	-	4,74																																																									
United States Treasury Bills	-	4,56																																																									
United States Treasury Bills	-	3,89																																																									
CBOE IBHY INDEX FUTURE MAR 26	-	1,96																																																									
United States Treasury Bonds	-	1,37																																																									
United States Treasury Bonds	-	1,34																																																									
United States Treasury Bonds	-	1,33																																																									
United States Treasury Bonds	-	1,33																																																									
% Primi 10 Titoli sul Patrimonio	31,69																																																										
Numeri Complessivo di Titoli Azionari	533																																																										
Numeri Complessivo di Titoli Obbligazionari	901																																																										
Fixed Income Sector Weightings %																																																											
Governativo		33,30																																																									
Societario		60,33																																																									
Cartolarizzazioni		23,54																																																									
Enti Locali		0,00																																																									
Liquidità ed equivalenti		-19,93																																																									
Derivati		2,75																																																									
Coupon Range %																																																											
0 coupon		10,73																																																									
Da 0 a 4 cedole		30,55																																																									
Da 4 a 6 cedole		32,43																																																									
Da 6 a 8 cedole		17,12																																																									
Da 8 a 10 cedole		7,66																																																									
Da 10 a 12 cedole		0,48																																																									
Oltre 12 cedole		1,03																																																									
Ripartizione Geografica %																																																											
America		98,94																																																									
Stati Uniti		96,72																																																									
Canada		2,23																																																									
America Latina e Centrale		0,00																																																									
Europa		1,06																																																									
Regno Unito		0,01																																																									
Europa Occidentale - Euro		0,67																																																									
Europa Occidentale - Non Euro		0,38																																																									
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 - Emergenti		0,00																																																									
Anagrafica																																																											
Società di Gestione	BlackRock Asset Management Ireland Ltd	Patrimonio Classe (Mln) (03/02/2026)	5,82 USD																																																								
Telefono	-	Domicilio	IRLANDA																																																								
Web	www.blackrock.com	Valuta del Fondo	USD																																																								
Data di Partenza	14/06/2021	UCITS	Si																																																								
Nome del Gestore	-	Inc/Acc	Acc																																																								
Data Inizio Gestione	-	ISIN	IE00BKPSQG65																																																								
NAV (03/02/2026)	USD 117,77																																																										
Patrimonio Netto (Mln)	156,38 USD																																																										
(31/12/2025)																																																											