

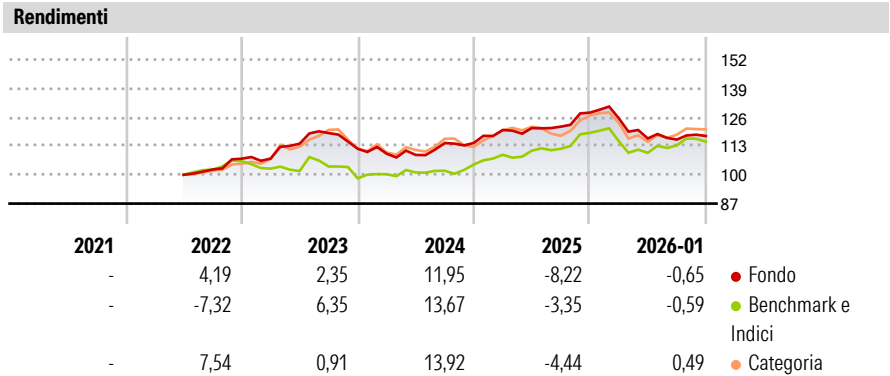
BlackRock Funds I ICAV - BlackRock Systematic Multi-Strategy Fund D USD Acc

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

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.

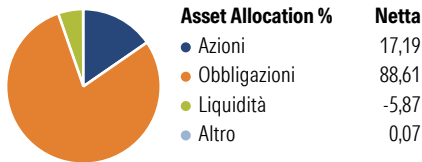
Misure di Rischio			
3Y Alpha	-1,10	3Y Sharpe Ratio	-0,12
3Y Beta	0,45	3Y Std Dev	6,84
3Y R-Squared	47,26	3Y Risk	Med
3Y Info Ratio	-0,67	5Y Risk	-
3Y Tracking Error	4,03	10Y Risk	-
Basati su Morningstar US Conservative Target Allocation NR USD (dove applicabile)			



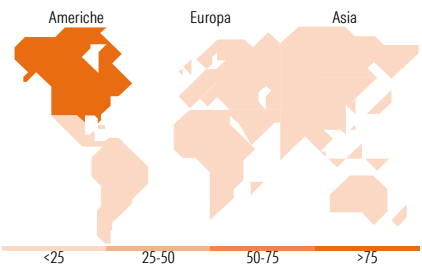
Rend. Cumulati %	Fondo	Bmk	Cat	Rendimenti Trimestrali %	Q1	Q2	Q3	Q4
3-Mesi	-0,01	-0,92	0,59	2026	-	-	-	-
6-Mesi	0,50	2,83	6,40	2025	-1,99	-7,26	-0,44	1,42
1-Anno	-9,60	-3,82	-2,85	2024	5,10	0,71	0,55	5,19
3-Anni Ann.ti	2,27	4,70	6,43	2023	-2,02	-0,49	4,92	0,06
5-Anni Ann.ti	-	-	-	2022	0,06	6,26	4,17	-5,93
10-Anni Ann.ti	-	-	-					

Rendimenti aggiornati al 03/02/2026

Portafoglio 31/12/2025



Fixed Income Style Box™	Fondo
Duration Effettiva	3,00
Maturity effettiva	4,23
Qualità Credito Media	BBB
Qualità Credito	
Alto	
Med	
Basso	
Sensibilità ai Tassi	
Bassa	
Med	
Alta	



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
Numero Complessivo di Titoli Azionari		533
Numero Complessivo di Titoli Obbligazionari		901

Fixed Income Sector Weightings %	Fondo
■ Governativo	33,30
■ Societario	60,33
■ Cartolarizzazioni	23,54
■ Enti Locali	0,00
■ Liquidità ed equivalenti	-19,93
■ Derivati	2,75
Coupon Range %	Fondo
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 %	Fondo
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 - Emergente	0,00

Anagrafica

Società di Gestione	BlackRock Asset Management Ireland Ltd	Patrimonio Classe (Mln)	5,82 USD	Investimento Min. Ingresso	5.000 USD
Telefono	-	(03/02/2026)		Investimento Min. Successivo	1.000 USD
Web	www.blackrock.com	Domicilio	IRLANDA	T.E.R.	-
Data di Partenza	14/06/2021	Valuta del Fondo	USD	Spese correnti	0,90%
Nome del Gestore	-	UCITS	Si	Commissione di incentivo	-
Data Inizio Gestione	-	Inc/Acc	Acc		
NAV (03/02/2026)	USD 117,77	ISIN	IE00BKPSQG65		
Patrimonio Netto (Mln)	156,38 USD				
(31/12/2025)					