

BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund A2 AUD

Morningstar Categorie Index

Morningstar US Conservative Target
Allocation NR USD

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

SOFR 3 month USD

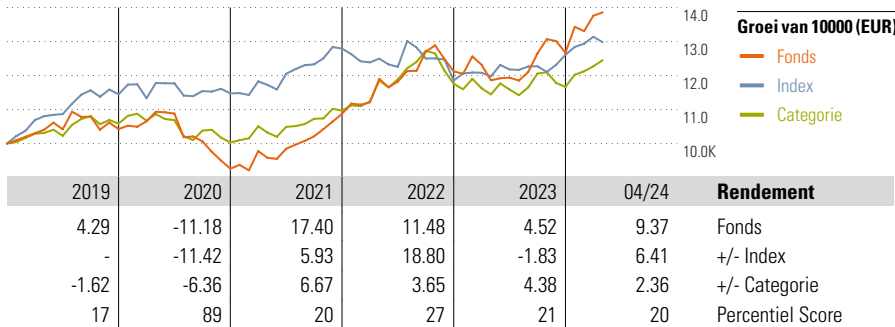
Morningstar Rating™

★★★★

Morningstar Categorie™

Beleggingsdoelstelling

The Fund aims to achieve a positive absolute return through a combination of capital growth and income on your investment regardless of market conditions in a manner consistent with the principles of environmental, social and governance (ESG) investing. The Fund will seek to achieve this investment objective by taking long, synthetic long and synthetic short investment exposures.



Risicomaatstaven

Alpha	5.65	Sharpe Ratio	1.31
Beta	0.06	Std Deviatie	8.63
R-kwadraat	0.64	3-jr Risico	Gem
Informatie Ratio	0.99	5-jr Risico	Gem
Tracking Error	9.38	10-jr Risico	Bov gem

Berekeningen met Morningstar US Con Tgt Alloc NR USD (waar van toepassing)

Rendementen (6 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	-1.21	-1.90	-3.76
6 Maanden	5.80	-1.53	-2.20
1 jaar	16.13	7.27	0.23
3 jr gean.	11.94	8.30	1.00
5 jr gean.	5.44	1.59	-1.30

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	8.58	-	-	-
2023	1.58	-3.05	5.98	0.13
2022	3.11	5.41	7.48	-4.57
2021	5.59	0.69	3.71	6.48
2020	2.18	2.12	-7.49	-7.99

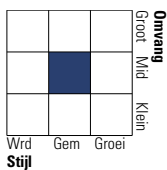
Portefeuille 31 mrt 2024

Assetverdeling

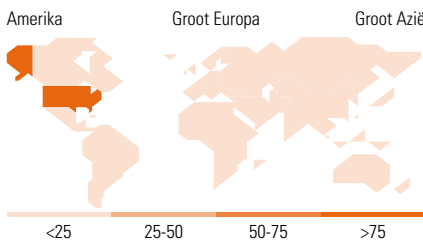
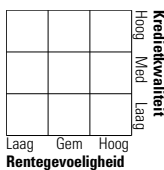
	% Long	% Short	% Netto
Aandelen	686.54	666.32	20.22
Obligaties	0.00	0.00	0.00
Kas/ geldmarkt	110.18	30.40	79.78
Overig	0.00	0.00	0.00

Morningstar Style Box

Stijl Aandelen



Stijl vastrentend



Top 10 Onderliggende posities

	Sector	% Port
CFD on Mastercard Inc Class A	—	5.53
CFD on Marsh & McLennan...	—	4.77
CFD on EOG Resources Inc	—	4.65
CFD on Microsoft Corp	—	4.64
CFD on Devon Energy Corp	—	4.58
Totaal Aantal Aandelen		3659
Totaal Aantal Obligaties		0
% Van vermogen in top 10 posities		24.17

Sectorverdeling

	% Aand
Cyclisch	0.00
Basismaterialen	-
Cyclische consumentenproducten	-
Financiële dienstverlening	-
Vastgoed	-
Licht Cyclisch	0.00
Communicatiediensten	-
Energie	-
Industrie	-
Technologie	-
Defensief	0.00
Defensieve consumptiegoederen	-
Gezondheidszorg	-
Nutsbedrijven	-

Regioverdeling

	% Aand
Amerika	99.15
Verenigde Staten	98.23
Canada	0.40
Latijns Amerika	0.52
Groot Europa	0.73
Verenigd Koninkrijk	0.41
West Europa – Euro	0.17
West Europa – Niet Euro	0.10
Emerging Europa	0.00
Midden-Oosten / Afrika	0.05
Groot Azië	0.11
Japan	0.00
Australazië	0.00
Azië - Ontwikkeld	0.10
Azië - Emerging	0.01

Fondsinformatie

Fondsgroep	BlackRock Investment Mgt....	Vestigingsland	Luxemburg	Min Aanvangsbedrag	5,000
Telefoon	+44 20 77433000	Fondsvaluta	AUD	Min Additioneel	1,000
Website	www.blackrock.com	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	1.50%
Oprichtingsdatum	10 okt 2012	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Travis Cooke	ISIN	LU0840974975		
Aanvangsdatum	17 feb 2012				
Koers (6 mei 2024)	AUD 251.82				
Fondsvermogen (mln)	USD 706.65				