

BlackRock Strategic Funds - Systematic US Equity Absolute Return Fund D2 GBP Hedged

Morningstar Categorie Index

Morningstar UK Cautious Target
Allocation NR GBP

Wordt gebruikt in dit rapport als index

Benchmark van het fonds

SOFR 3 month USD

Morningstar Rating™

—

Morningstar Categorie™

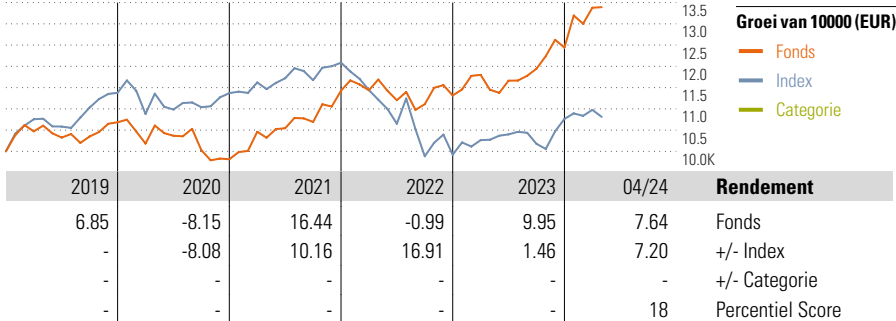
Beleggingsdoelstelling

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	5.46	Sharpe Ratio	1.03
Beta	-0.05	Std Deviatie	7.52
R-kwadraat	0.37	3-jr Risico	-
Informatie Ratio	1.27	5-jr Risico	-
Tracking Error	8.62	10-jr Risico	-

Berekeningen met Morningstar UK Cau Tgt Alloc NR GBP (waar van toepassing)



Rendementen (3 mei 2024)

	Rend %	+/-Idx	+/-Cat
3 Maanden	0.07	0.47	-
6 Maanden	8.10	1.40	-
1 jaar	16.05	10.39	-
3 jr gean.	8.84	10.74	-
5 jr gean.	4.39	4.29	-

Kwartaalrendementen

	1e kw	2e kw	3e kw	4e kw
2024	7.53	-	-	-
2023	4.28	-1.15	2.42	4.15
2022	0.09	-2.05	-0.83	1.83
2021	6.59	0.80	1.39	6.89
2020	-4.70	1.81	-3.28	-2.12

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

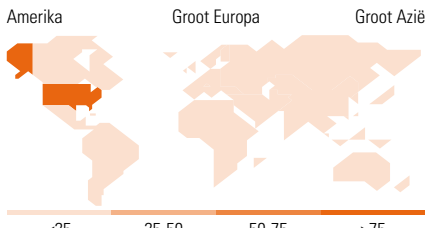
Morningstar Style Box

Stijl Aandelen

	Wrd	Gem	Groei
Omvang			
Groot			
Mid			
Klein			
Stijl			

Stijl vastrentend

	Laag	Gem	Hoog
Kredietkwaliteit			
Hoog			
Med			
Laag			
Rentegevoeligheid			



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	100,000
Telefoon	+44 20 77433000	Fondsvaluta	GBP	Min Additioneel	-
Website	www.blackrock.com	UCITS	ja	Jaarlijkse Management Fee	1.00%
Oprichtingsdatum	1 jul 2015	Inc/Acc	Acc		
Fondsmanager	Travis Cooke	ISIN	LU1246651910		
Aanvangsdatum	17 feb 2012				
Koers (3 mei 2024)	GBP 137.48				
Fondsvermogen (mln)	USD 706.65				