

BlackRock Strategic Funds - Managed Index Portfolios Defensive A2 EUR

Morningstar® Category Index

Cat 75%Barclays Euro Agg TR&25%FTSE
Wld TR

(Usado ao longo do relatório)

Benchmark do fundo

10% MSCI ACWI NR EUR, 90% BBgBarc
Global Aggregate TR Hdg EUR

Morningstar Rating™

★★★★

Categoria Morningstar™

Mistos Defensivos EUR

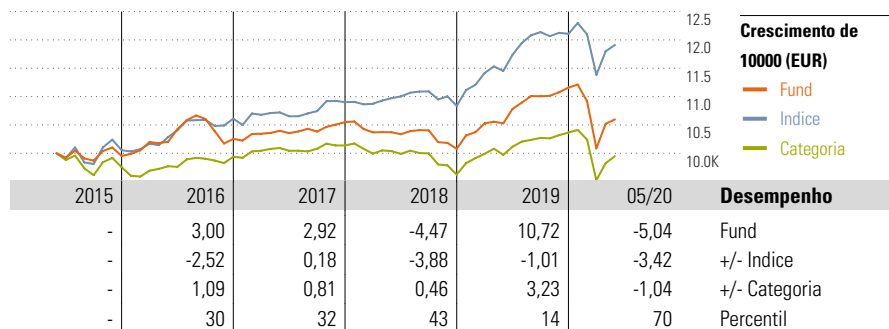
Política de investimento

The Fund aims to deliver a total return, which is a combination of capital growth and income, commensurate with a moderate level of risk. The Fund will seek to achieve its investment objective by obtaining indirect exposure to equity and equity-related securities, fixed income and fixed income-related securities, alternative assets, cash and nearcash instruments. Exposure to these asset classes will be achieved through investments in units of undertakings for collective investment, including but not limited to...

Medidas de Risco

Alfa	-3,19	Rácio de Sharpe	0,20
Beta	1,09	Desv.Padrão(3a.)	6,13
R²	89,85		
Rácio de informação	-1,46		
Tracking Error	2,01		

Cálculos usando o Cat 75%Barclays EurAgg TR&25%FTSE Wld TR (onde aplicável)



Rend. Anualiz. %

(9 jun 2020)

	Rentabilid ade	+/-Ind	+/-Cat
3 meses	0,32	0,28	0,98
6 meses	-3,52	-3,39	-1,37
1 ano	0,15	-4,01	-0,53
3 anos anualiz.	0,87	-3,04	0,70
5 anos anualiz.	1,52	-2,46	0,75

Risco

◀ Menor risco Maior risco ▶

Remunerações tipicamente mais baixas

Remunerações tipicamente mais altas

1 2 3 4 5 6 7

Fonte: Morningstar

Carteira 30 abr 2020

Aloc. de ativos	% longo	% curto	% líquido
Ações	13,33	0,00	13,33
Obrigações	81,21	0,00	81,21
Liquidez	5,55	2,56	2,99
Outro	2,47	0,00	2,47

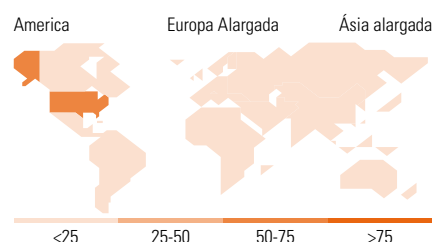
Morningstar Style Box™

Estilo de ações

	Grd.	Med.	Pequena
Capitalização			
Valor			
Misto			
Crescimento			
Estilo			

Estilo de obrigações

	Baixa	Média	Alta
Qualidade creditícia			
Sensibilidade às taxas de ju			



As 10 maiores posições	Setor	% Cart.
iShares \$ Treasury Bd 1-3yr ETF...	—	17,79
iShares \$ Corp Bond ETF USD Dist	—	10,39
iShares € Govt Bond 0-1yr ETF...	—	10,27
iShares MSCI USA ESG Enh ETF...	—	7,79
iShares US Mortg Backed Secs...	—	5,79
iShares \$ Corp Bond Intr Rt H...	—	5,78
iShares € CorpBd IntrRt Hdg...	—	5,39
iShares Em Mkts Govt Bd Idx...	—	3,80
iShares \$ TIPS ETF USD Acc	—	3,62
iShares France Govt Bond ETF...	—	3,54
Nº Total de Ações		0
Nº Total de Obrigações		0
% de ativos nas 10 maiores posições		74,16

Distribuição por sectores

	% Ações
Cyclical	31,14
Materiais Básicos	4,04
Consumo Cíclico	9,41
Serviços Financeiros	14,28
Imóvel	3,41
Sensitive	40,64
Serviços de Comunicação	8,55
Energia	2,57
Produtos Industrializados	9,72
Tecnologia	19,80
Defensive	28,22
Consumo Defensivo	9,04
Saúde	15,48
Serviços públicos	3,69

Desagregação por regiões

	% Ações
América	68,99
Estados Unidos	68,33
Canadá	0,60
América Latina	0,06
Europa	19,71
Reino Unido	1,45
Zona Euro	12,36
Europa (ex Zona Euro)	5,81
Europa - Emergente	0,03
Middle East / Africa	0,06
Ásia	11,30
Japão	2,42
Australasia	0,35
Ásia - desenvolvida	0,64
Ásia - Emergente	7,89

Informação

Nome do grupo	BlackRock (Luxembourg) SA	Domicílio	Luxemburgo	Montante mínimo inicial
Telefone	+44 20 77433000	Moeda do fundo	EUR	Montante mínimo adicional
Site Internet	www.blackrock.com	UCITS	Sim	
Data do lançamento	3 jun 2015	Inc/Acc	Acc	
Nome do gestor	Stephen Walker	Isin	LU1241524617	
Data de recrutamento	10 abr 2015			
VL (9 jun 2020)	EUR 106,83			
Ativos Liq.(Milh)	EUR 225,28			