

BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund

D U.S. Dollar

BlackRock Funds I ICAV

O Desempenho, a Discriminação da Carteira e as informações dos Activos Líquidos referem-se à data de: 31 jul. 2024. Todos os outros dados a data de: 12 ago. 2024.

O presente documento constitui um elemento de promoção comercial. Para investidores do Portugal. Antes de investir, os investidores devem ler o KIID/documento PRIIP e o prospeto e consultar a lista completa de riscos dos fundos no prospeto.

RESUMO DO FUNDO

- O Fundo visa atingir um retorno total do investimento, através de uma combinação de aumento do capital e rendimento dos ativos do Fundo, de uma forma consistente com o investimento nas dimensões "ESG".
- O Fundo tem uma abordagem flexível à alocação de ativos e procurará obter exposição a uma variedade de classes de ativos. Para atingir o seu objetivo, o Fundo investirá a nível mundial em valores mobiliários representativos de capital próprio (p. ex., ações), títulos relacionados com ações, valores mobiliários de rendimento fixo (RF) (p. ex., obrigações), valores mobiliários convertíveis em valores mobiliários de RF, instrumentos do mercado monetário (IMM) (p. ex., instrumentos de dívida com vencimento a curto prazo), valores mobiliários garantidos por ativos (ABS) e valores mobiliários garantidos por hipotecas (MBS) (ou seja, valores mobiliários financeiros garantidos por fluxos de caixa de dívida), depósitos, numerário e outros fundos (incluindo fundos negociados em bolsa). Os valores mobiliários de RF e os IMM podem ser emitidos por governos, agências governamentais, empresas e entidades supranacionais (p. ex., o Banco Internacional para a Reconstrução e Desenvolvimento) a nível mundial e podem incluir investimentos com uma notação de crédito relativamente baixa ou sem notação. O Fundo pode assumir exposições longas, longas sintéticas e curtas sintéticas. O Fundo pode ter uma exposição tanto a mercados desenvolvidos como a mercados emergentes. No entanto, não devem ser investidos mais de 20% dos ativos do Fundo em valores mobiliários emitidos por emittentes estabelecidos em mercados emergentes.
- Para determinar exposições longas e curtas, o gestor de investimento (GI) usará modelos quantitativos (ou seja, matemáticos ou estatísticos) para pontuar e classificar os valores mobiliários, em termos gerais, de acordo com três categorias: informação fundamental sobre o emitente de um título (por exemplo, relatórios financeiros), sentimento do mercado em relação ao título e comparação do seu preço de mercado com o seu valor intrínseco. Os valores mobiliários com menor pontuação são então analisados pelo GI para efeitos de exclusão da carteira do Fundo.

INDICADOR DE RISCO

Menor risco

Resultados potencialmente mais reduzidos

Maior risco

Resultados potencialmente mais elevados



CAPITAL EM RISCO: O valor investido e seus rendimentos podem sofrer reduções ou aumentos e não são garantidos. Investidores podem não reaver o montante originalmente investido.

PRINCIPAIS RISCOS:

- As alterações das taxas de juro, o risco de crédito e/ou os incumprimentos de emittentes terão um impacto significativo nos resultados dos títulos de rendimento fixo. Os títulos de rendimento fixo classificados como "non-investment grade" podem ser mais sensíveis a estes riscos do que os títulos de rendimento fixo com notações superiores. As revisões em baixa das notações de crédito, potenciais ou efectivas, podem aumentar o nível de risco.
- Os instrumentos de dívida titularizados ABS e MBS estão sujeitos aos mesmos riscos dos títulos de rendimento fixo. Estes instrumentos podem estar sujeitos ao risco de liquidez, apresentar elevados níveis de endividamento e não reflectir inteiramente o valor dos activos subjacentes.
- O risco de investimento está concentrado em setores, países, moedas ou empresas específicos. Isto significa que o Fundo é mais sensível a quaisquer eventos económicos, políticos, ou no âmbito dos mercados, sustentabilidade ou regulamentação.
- Os movimentos diários dos mercados de ações, influenciados por factores como as notícias políticas e económicas, os resultados das empresas e acontecimentos importantes da vida das empresas, podem afectar o valor das ações e dos títulos conexos com ações.

CARACTERÍSTICAS CHAVE

Alvo¹: ICE BofAML 3 Month Treasury Bill Index

Classe de ativos: Obrigações

Data do Início do Fundo: 14 jun. 2021

Data de lançamento da classe de ações: 14 jun. 2021

Moeda de classe de ação: USD

Utilização da Renda: Acumulação

Valor líquido de inventário do fundo (M): 100.14 USD

Categoria Morningstar: -

Classificação SFDR: Artigo 8º

Domicílio: Irlanda

ISIN: IE00BKPSQG65

Sociedade Gestora: BlackRock Asset Management Ireland Limited

* ou moeda equivalente

COMISSÕES E DESPESAS

Taxa de Gestão Anual: 0.00%

Custo corrente: 0.90%

Taxa de performance: 0.00%

INFORMAÇÕES DE TRANSAÇÃO

Investimento Inicial Mínimo: 5,000 USD *

Liquidação: Data de transacção + 3 dias

Frequência de negociação: Base de determinação de preços diários e futuros

* ou moeda equivalente

CARACTERÍSTICAS DO PORTFOLIO

Effective Duration: 3.12

Maturidade média ponderada: 4.42

Maturidade Média Ponderada: 5.04%

Desvio padrão (3 anos): 4.09

Beta a 3 anos: 1.38

Número de componentes: 1,327

GESTÃO DE PORTEFÓLIO

Tom Parker

Scott Radell

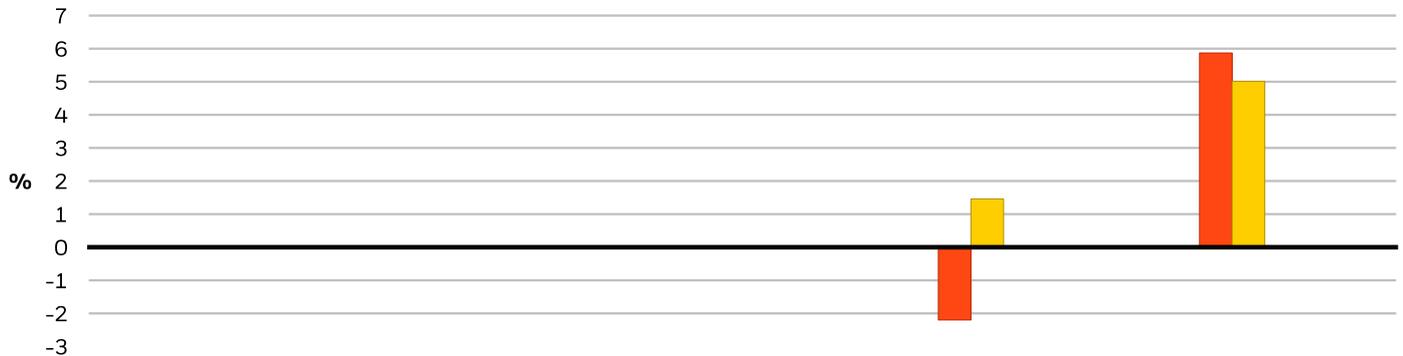
Jeffrey Rosenberg

- O Fundo procura excluir as empresas que exercem certas atividades incompatíveis com os critérios ASG. Por conseguinte, os investidores devem efetuar uma avaliação ética pessoal da análise de ASG do Fundo antes de investirem no Fundo. Essa análise de ASG pode ter um impacto negativo no valor dos investimentos do Fundo em comparação com um fundo que não esteja sujeito a essa mesma análise.
- O Fundo utiliza modelos quantitativos para tomar decisões de investimento. Dado que a dinâmica do mercado se altera ao longo do tempo, um modelo quantitativo pode tornar-se menos eficiente ou mesmo apresentar deficiências em determinadas condições de mercado.
- Risco de contraparte: a insolvência de quaisquer instituições prestadoras de serviços, tais como a custódia de ativos ou a atuação como contraparte de derivados ou outros instrumentos, pode expor o Fundo a perdas financeiras.
- Risco de crédito: o emitente de um activo financeiro detido pelo Fundo pode não pagar o rendimento do capital ou proceder ao reembolso do capital ao Fundo, no respectivo vencimento.
- Risco de liquidez: Menor liquidez significa que não há compradores ou vendedores suficientes para o Fundo vender ou comprar investimentos de imediato.

**BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG
Screened Fund
D U.S. Dollar
BlackRock Funds I ICAV**

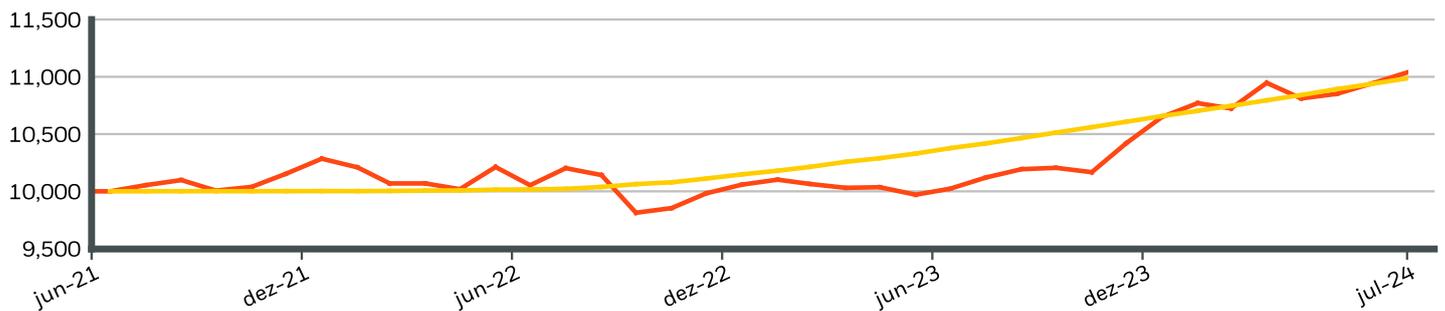


DESEMPENHO DO ANO



	2019	2020	2021	2022	2023
Classe do fundo	-	-	-	-2.20	5.87
Alvo¹¹	-	-	-	1.46	5.01

CRESCIMENTO HIPOTÉTICO DE 10.000 USD DESDE O LANÇAMENTO



RENDIBILIDADE ACUMULADA E ANUAL

	ACUMULADO (%)					ANUALIZADO (% p.a.)		
	1m	3m	6m	YTD	1 Ano	3 Anos	5 Anos	Desde sua criação
Classe do fundo	0.89	2.10	2.49	3.65	9.06	3.16	-	3.31
Alvo¹¹	0.45	1.34	2.65	3.09	5.45	3.18	-	3.05

Os números mostrados dizem respeito ao desempenho passado. O desempenho passado não é um indicador fiável de resultados futuros e não deve ser o único fator em consideração ao selecionar um produto ou estratégia. Desempenho da classe de ações e referencial apresentado em USD, referencial do fundo hedged apresentado em USD. O desempenho é apresentado numa base de Valor Contabilístico Líquido, com o reinvestimento dos rendimentos brutos, conforme aplicável. O retorno do seu investimento poderá aumentar ou diminuir em resultado de flutuações cambiais se o seu investimento tiver sido feito numa moeda diferente da utilizada no cálculo do desempenho passado. **Fonte:** BlackRock

Classe do fundo BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened FundD U.S. Dollar
Alvo¹¹ ICE BofAML 3 Month Treasury Bill Index

Contacte-nos

For EMEA: +353 1 612 3394 • www.blackrock.com • investor.services@blackrock.com

BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund D U.S. Dollar BlackRock Funds I ICAV

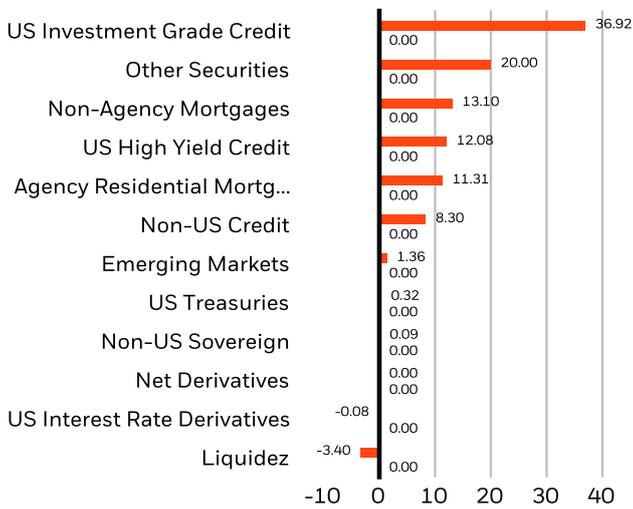


TÍTULOS 10 PRINCIPAIS (%)

UNIFORM MBS	7.55%
ISHARES BROAD USD HIGH YIELD CORP BOND USD INC	6.54%
GOVERNMENT NATIONAL MORTGAGE ASSOCIATION II	3.08%
JPMORGAN CHASE & CO	1.41%
BANK OF AMERICA CORP	1.38%
AMERICAN EXPRESS COMPANY	1.31%
MCDONALDS CORPORATION	1.18%
CITIGROUP INC	1.18%
MOTOROLA SOLUTIONS INC	1.17%
MPLX LP	1.11%
Total da Carteira	25.91%

As participações estão sujeitas a alterações

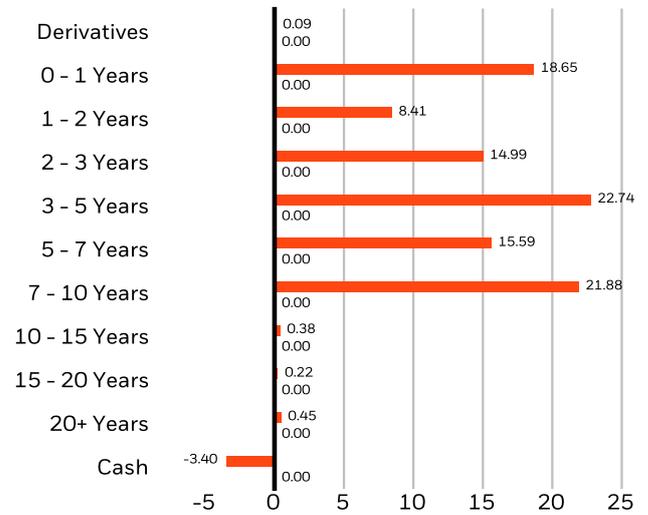
EXPOSIÇÃO POR SETOR (%)



Fundo ■ Índice referência ■

As alocações estão sujeitas a alterações. Fonte: BlackRock

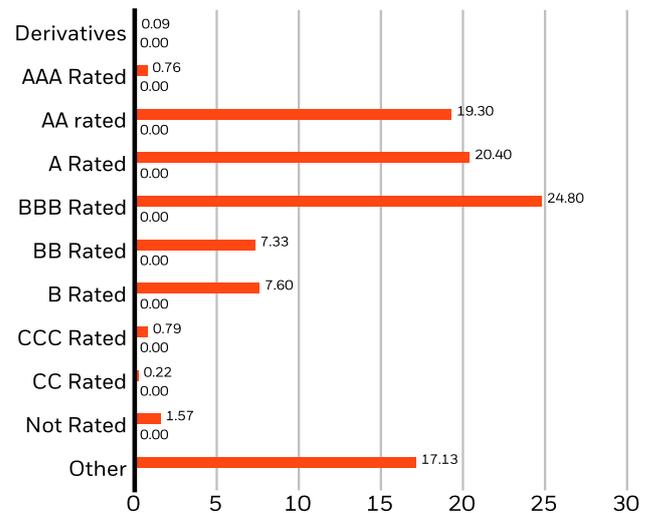
DISCRIMINAÇÃO POR VENCIMENTO (%)



Fundo ■ Índice referência ■

As alocações estão sujeitas a alterações. Fonte: BlackRock

QUALIDADE DE CRÉDITO (%)



Fundo ■ Índice referência ■

As alocações estão sujeitas a alterações. Fonte: BlackRock

Contacte-nos

For EMEA: +353 1 612 3394 • www.blackrock.com • investor.services@blackrock.com

BlackRock Systematic Multi-Strategy ESG Screened Fund D U.S. Dollar BlackRock Funds I ICAV

BlackRock

GLOSSÁRIO

Classificação SFDR: Artigo 8º: Produtos que promovem características ambientais ou sociais e promovem boas práticas de governança. **Artigo 9º:** Produtos que têm como objetivo investimentos sustentáveis e seguem boas práticas de governança. **Outro:** Produtos que não cumprem os critérios para serem classificados como incluídos no Artigo 8.º ou 9º

Maturidade Média Ponderada: Maturidade Média Ponderada (YTM) é a taxa de desconto que iguala o valor presente dos fluxos de caixa de um título com seu preço de mercado (incluindo juros acumulados). O YTM médio do fundo é a média ponderada dos YTM dos títulos individuais do fundo com base no Valor Líquido do Ativo ('NAV'). A medida não inclui taxas e despesas. Para títulos resgatáveis, YTM é o rendimento para o pior.

Duração efectiva: a duração efectiva é uma medida da sensibilidade de um fundo às taxas de juro. Em termos simplificados, quanto maior for a duração de um fundo, mais sensível o fundo é às variações nas taxas de juro. Assim, um fundo com uma duração de 10 anos é duas vezes mais volátil do que um fundo com uma duração de cinco anos.

INFORMAÇÃO IMPORTANTE:

As ponderações negativas podem resultar de circunstâncias específicas (incluindo diferenças temporais entre as datas de troca e de fecho dos títulos adquiridos pelos fundos) e/ou do uso de determinados instrumentos financeiros, incluindo derivados, que podem ser utilizados para aumentar ou reduzir a exposição ao mercado e/ou a gestão do risco.

No EEE (Espaço Económico Europeu): emitido pela BlackRock (Netherlands) B.V., autorizada e regulada pela Autoridade Holandesa para os Mercados Financeiros. Sede Amstelplein 1, 1096 HA Amsterdão, Tel.: 020 – 549 5200, Tel.: 31-20-549-5200. Registo Comercial n.º 17068311 Para a sua proteção, as chamadas telefónicas são geralmente gravadas.

BlackRock Funds I ICAV: O presente documento constitui um elemento de promoção comercial. Este fundo é um subfundo do BlackRock Funds I ICAV (o "Fundo"). O Fundo está estruturado como um fundo comum de investimento organizado nos termos da legislação da Irlanda e autorizado pelo Banco Central da Irlanda, como OICVM para efeitos dos Regulamentos OICVM. O investimento no subfundo apenas se encontra acessível a "Titulares Qualificados", como definido no Prospecto do Fundo relevante. No Reino Unido, qualquer decisão de investimento deverá basear-se exclusivamente nas informações contidas no Prospecto da Sociedade, no Documento de Informações Fundamentais destinadas aos Investidores (KIID) e no último relatório e contas semestral não auditado e/ou no relatório e contas anual auditado. No EEE e na Suíça, qualquer decisão de investimento deverá basear-se exclusivamente nas informações contidas no Prospecto da Sociedade, nos relatórios financeiros mais recentes, no Documento de Informação Fundamental para Pacotes de Produtos de Investimento de Retalho e de Produtos de Investimento com Base em Seguros (PRIIP KID) e no último relatório e contas semestral não auditado e/ou no relatório e contas anual auditado, que estão disponíveis em jurisdições registadas e no idioma local onde se encontram registadas, que podem ser consultados em www.blackrock.com, nas páginas relevantes do produto. Antes de investir, os investidores devem compreender todas as características do objetivo dos fundos. Os Prospectos, os Documentos de Informação Fundamental Destinadas aos Investidores, os Documento de Informação Fundamental PRIIP e os formulários de subscrição podem não estar disponíveis para os investidores em determinadas jurisdições em que o Fundo em questão não tenha sido autorizado. A BlackRock pode pôr termo à comercialização em qualquer altura. Para obter informações sobre os direitos dos investidores e o modo de apresentação de reclamações, aceda a <https://www.blackrock.com/corporate/compliance/investor-right> disponível no idioma local nas jurisdições registadas.

Qualquer estudo contido no presente documento foi encomendado e pode ter sido utilizado pela BlackRock para os seus próprios fins. Os resultados de tais estudos são disponibilizados apenas a título acessório. As opiniões expressas não constituem conselhos de investimento ou quaisquer outros conselhos e estão sujeitas a alterações. As mesmas não refletem necessariamente as opiniões de qualquer empresa do Grupo BlackRock ou de qualquer parte do mesmo, e não são prestadas quaisquer garantias quanto à sua exatidão.

O presente documento tem fins meramente informativos e não constitui uma oferta ou convite a qualquer pessoa para investir em quaisquer fundos ou produtos da BlackRock, e não foi preparado em ligação com qualquer oferta desse tipo.

© 2024 BlackRock, Inc. Todos os direitos reservados. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS e iSHARES são marcas registadas da BlackRock, Inc. ou das suas subsidiárias nos Estados Unidos e noutros países. Todas as outras marcas registadas pertencem aos respetivos proprietários.

Contacte-nos

For EMEA: +353 1 612 3394 • www.blackrock.com • investor.services@blackrock.com