ESG Report

Stand: 31.10.2026

Gegenstand dieses Dokuments sind Nachhaltigkeitsinformationen zu diesem Finanzprodukt. Es handelt sich um Werbematerial. Für Informationen über die berücksichtigten Umweltziele lesen Sie bitte aufmerksam die Nachhaltigkeitsinformationen des Herstellers. Der Grundsatz „Vermeidung erheblicher Beeinträchtigungen“ findet nur bei denjenigen dem Finanzprodukt zugrunde liegenden Investitionen Anwendung, die die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten berücksichtigen. Die dem verbleibenden Teil dieses Finanzprodukts zugrunde liegenden Investitionen berücksichtigen nicht die EU-Kriterien für ökologisch nachhaltige Wirtschaftsaktivitäten.

BlackRock Strategic Funds - Managed Index Portfolios - Defensive D5 EUR

ISIN / WKN	LU1191062576 / A14QTK
Emittent / Hersteller	BlackRock (Luxembourg) S.A.
Benchmark	-
EU-Offenlegungskategorisierung*	Artikel 8 Einstufung nach Verordnung (EU) 2019/2088 über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR)
PAI Berücksichtigung**	Ja, für folgende Kriterien: Treibhausgas-Emissionen
Verkaufsprospekt	Link
SFDR vorvertragliche Informationen***	Link
SFDR regelmäßige Informationen***	Link
SFDR Website Informationen***	Link
ESG-Fokus	-
Aktualisierung durch Hersteller	01.10.2026

* Artikel 6: Finanzprodukte, die weder ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, noch nachhaltige Investitionen anstreben; Artikel 8: Finanzprodukte, die ökologische und/oder soziale Merkmale bewerben, und die Unternehmen, in die investiert wird, wenden Verfahrensweisen einer guten Unternehmensführung an; Artikel 9: Finanzprodukte, die nachhaltige Investitionen anstreben.

** PAI (Principle Adverse Impact) sind die negativen Auswirkungen von Investitionsentscheidungen auf Nachhaltigkeitsfaktoren.

*** SFDR - Sustainable Finance Disclosure Regulation (Offenlegungsverordnung)

Mindestanteil von nachhaltigen Anlagen nach Taxonomie-Verordnung



0,00 %

ESG Report

Anlagestrategie

Der Fonds strebt unter Berücksichtigung von Kapitalwachstum und Erträgen die Erzielung einer Rendite auf Ihre Anlage an. Zu diesem Zweck investiert er in ein aktiv verwaltetes Multi-Asset-Portfolio und bezieht bei der Vermögensallokation strategische sowie taktische Erwägungen ein, wobei ein defensives Risikoniveau beibehalten wird. Gleichzeitig investiert er in einer Weise, die den Grundsätzen für Anlagen in den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) entspricht. Der Fonds strebt ein indirektes Engagement in einem breiten Spektrum von Anlageklassen an. Diese können Eigenkapitalinstrumente (z. B. Aktien), eigenkapitalbezogene (eb) Wertpapiere, festverzinsliche (fv) Wertpapiere (z. B. Anleihen), auf fv Wertpapiere bezogene Wertpapiere, alternative Vermögenswerte, Barmittel und barmittelähnliche Instrumente umfassen. fv Wertpapiere umfassen Geldmarktinstrumente (GMI) (d. h. Schuldverschreibungen mit kurzen Laufzeiten). eb Wertpapiere und auf fv Wertpapiere bezogene Wertpapiere sind unter anderem derivative Finanzinstrumente (FD) (d. h. Anlagen, deren Preise auf einem oder mehreren zugrunde liegenden Vermögenswerten basieren). Das Engagement in diesen Anlageklassen wird durch Anlagen in einem konzentrierten Portfolio aus Aktien oder Anteilen an Organismen für gemeinsame Anlagen (OGA) erreicht, die ihrerseits in einem diversifizierten Portfolio von Vermögenswerten anlegen. Diese können u. a. aktive und passive börsengehandelte Fonds und andere Indexfonds umfassen, die von einem Unternehmen der BlackRock-Gruppe verwaltet werden. Das Gesamtvermögen des Fonds wird in Übereinstimmung mit seiner ESG-Politik angelegt, wie im Prospekt beschrieben. Angesichts seines defensiven Risikoprofils strebt der Fonds ein geringeres Engagement in Aktienwerten im Vergleich zu einem Fonds mit einem höheren Risikoprofil an, welcher in der Regel ein niedrigeres Engagement in festverzinslichen Wertpapieren anstreben würde. Das Engagement des Fonds in festverzinslichen Wertpapieren setzt sich in erster Linie aus fest- und variabel verzinslichen globalen Staatsanleihen und von Unternehmen begebenen festverzinslichen Wertpapieren/Anleihen mit Investment-Grade-Rating zusammen (es sind aber auch Papiere ohne Investment-Grade-Rating oder ganz ohne Rating zulässig). Die direkten und indirekten Anlagen des Fonds in fv Wertpapieren ohne Investment-Grade-Rating werden 20 % seines Nettoinventarwerts (NIW) nicht übersteigen.Das Aktienengagement wird hauptsächlich Unternehmen mit hoher und mittlerer Marktkapitalisierung weltweit umfassen. Die direkten und indirekten Aktienanlagen des Fonds werden im Laufe der Zeit schwanken, jedoch 30 % seines NIW nicht übersteigen. Der Fonds kann direkt und indirekt mit bis zu 20 % seines NIW in Asset-Backed Securities und Mortgage-Backed Securities engagiert sein, und sein indirektes Engagement in notleidenden Wertpapieren darf 10 % des NIW nicht übersteigen. Der Fonds wird aktiv verwaltet und es liegt im Ermessen des Anlageberaters (AB), die Anlagen des Fonds auszuwählen. Dabei ist er nicht an eine Benchmark gebunden. Anteilinhaber können den MSCI All Country World Index sowie den Bloomberg Multiverse Index zur Messung der Performance des Fonds in Bezug auf seine ESG-Verpflichtungen nutzen. Die Vermögensallokation des Fonds und die Gewichtung der einzelnen Anlageklassenindizes im Anlageuniversum können Änderungen unterliegen. Der Preis der zugrunde liegenden Fonds ändert sich regelmäßig in Abhängigkeit von der Wertentwicklung der von den zugrunde liegenden Fonds gehaltenen Vermögenswerte, was sich wiederum auf den Wert Ihrer Anlage auswirken kann. Der Fonds legt in fv Wertpapieren, Eigenkapitalinstrumenten und Organismen für gemeinsame Anlagen an, sodass der Wert Ihrer Anlage von den Faktoren beeinflusst werden kann, die den Wert dieser Anlageklassen beeinflussen. Die Rendite aus Ihrer Anlage in dem Fonds steht in direktem Verhältnis zum Wert der dem Fonds zugrunde liegenden Vermögenswerte, abzüglich der Kosten (siehe nachfolgend unter „Welche Kosten entstehen?“). Das Verhältnis zwischen der Rendite Ihrer Anlage, den Faktoren, die sie beeinflussen, und der Dauer, für die Sie Ihre Anlage halten sollten, wird im nachfolgenden Kapitel behandelt (siehe „Wie lange sollte ich die Anlage halten, und kann ich vorzeitig Geld entnehmen?“). Die Verwahrstelle des Fonds ist die State Street Bank International GmbH, Zweigniederlassung Luxemburg. Weitere Informationen über den Fonds sind in den aktuellen Jahres- und Halbjahresberichten der BlackRock Strategic Funds enthalten. Diese Dokumente sind kostenlos in Englisch und mehreren weiteren Sprachen verfügbar. Diese sowie weitere (praktische) Informationen, einschließlich der Preise der Anteile, erhalten Sie auf der BlackRock-Website unter www.blackrock.com oder telefonisch beim International Investor Servicing Team unter +352 46268 5111. Ihre Anteile werden ausschüttende Anteile sein (d. h., Dividendenerträge werden auf die Anteile vierteljährlich ausgeschüttet). Ihre Anteile werden in Euro, der Basiswährung des Fonds, denominiert. Die Anteile können täglich veräußert und erworben werden. Der Mindestbetrag für die Erstzeichnung von Anteilen dieser Anteilsklasse beträgt 100.000 USD oder den entsprechenden Gegenwert in einer anderen Währung.

Rechtliche Informationen

Bei den vorangegangenen Informationen handelt es sich um Angaben der jeweiligen Fondsgesellschaft, welche von uns als verlässlich eingestuft wurden. Wir können jedoch keine Garantie für Richtigkeit und Vollständigkeit übernehmen. Alleinige Grundlage für den Kauf von Wertpapieren sind nur die aktuellen Verkaufsunterlagen (Wesentliche Anlegerinformationen (KIID),Verkaufsprospekt, Jahresbericht und der Halbjahresbericht) zu den jeweiligen Investmentfonds.

Die offengelegten ESG-Informationen werden der cleversoft GmbH von der genannten Kapitalanlagegesellschaft (Hersteller) und ISS STOXX zur Verfügung gestellt. Die ESG-Informationen werden mit größtmöglicher Sorgfalt erstellt, regelmäßig geprüft und aktualisiert. Trotz aller Sorgfalt können sich die Informationen inzwischen verändert haben oder auf fehlerhaften Daten Dritter basieren. Die Versicherungsgesellschaft und cleversoft GmbH können keine Gewähr für die Richtigkeit, Vollständigkeit und Aktualität der ausgewiesenen Daten übernehmen. Die in dem ESG-Dokument publizierten Informationen stellen keine Empfehlung, Angebot oder Aufforderung zur Investition in einen Fo

ESG Report

Daten zur ESG-Bewertung, zu den SDGs sowie zur CO_2-Intensität, bereitgestellt von ISS STOXX*

BlackRock Strategic Funds - Managed Index Portfolios - Defensive D5 EUR

Das ISS STOXX ESG Fonds Rating bietet einen relativen Überblick über die ESG-Leistungsbewertung des Fonds auf einer Skala von 1 (schlechtester Wert) bis 5 (bester Wert). Der Gesamtscore basiert auf einer gewichteten ESG-Leistungsbewertung, bei der die Leistung der Emittenten und der Vergleichsgruppe anhand zentraler ESG-Kriterien auf einer Skala von 0 bis 100 bewertet wird. Fonds mit einer im Vergleich zu ihren Mitbewerbern niedrigeren gewichteten ESG-Leistungsbewertung weisen eine geringere Nachhaltigkeitsleistung auf.

Der Wert der Vergleichsgruppe (Lipper Global Mixed Asset EUR Conservative - Global) ist ein Durchschnitt der Fondswerte innerhalb der Gruppe. Zur Definition der Vergleichsgruppe für relevante Berechnungen wird das Lipper Global Classification (LGC)-System verwendet.

ISS STOXX ESG Fonds Rating

★★★☆☆

ESG Leistungsbewertung

Fonds	Vergleichsgruppe
49,87	55,47

ESG-Wertung

Umwelt



Soziales



Unternehmensführung



▼ Fonds ▲ Vergleichsgruppe

Die Balkendiagramme zeigen einen Vergleich der Leistungsbewertung des Fonds und der Vergleichsgruppe je E-, S- und G-Pfeiler anhand gewichteter Durchschnittswerte sowie der Spannweite von besten bis schlechtesten Einzeltitelbewertungen. Dabei stellt A+ den besten und D- den schlechtesten Wert dar.

Beitrag zu den UN-Nachhaltigkeitszielen (SDG)

SDG-Impact-Bewertung



Gewichteter Durchschnitt der SDG-Impact-Ratings der Portfoliopositionen. Auf Emittentenebene werden je SDG-Bewertung nur die prägnantesten Zielbeiträge berücksichtigt (höchster positiver und/oder niedrigster negativer Wert). Die Skala reicht von -10,0 (stark negativer Impact) bis +10,0 (stark positiver Impact).

SDG-Abdeckungsquote



Zeigt den Abdeckungsgrad des Fondsportfolios basierend auf den gewichteten Positionen, die in die SDG-Impact-Bewertung einfließen.

Positiver Impact (Score > +0,5)



3,14	3,13	3,00	2,89	2,25	1,78	0,99	0,98

Neutraler Impact (Score -0,5 bis +0,5)



0,27

Negativer Impact (Score < -0,5)

Keiner

Hinweis: Die Zuordnung der 17 SDGs in positive, neutrale und negative Gruppen erfolgt auf Basis der jeweiligen SDG-Einzelbewertungen (-10 bis +10).

ESG Report

CO_2-Intensität und Klimakennzahlen

Relativer CO_2-Fußabdruck

Fonds	**26,91**
Vergleichsgruppe	**37,59**

50
tCO_2e/Mio. USD investiert

Zeigt den relativen CO_2-Fußabdruck auf Basis der Emissionsbelastung (tCO_2e) je 1 Mio. USD investiertes Kapital.

Gewichtete CO_2-Intensität

Fonds	**76,48**
Vergleichsgruppe	**84,77**

100
tCO_2e/Mio. USD Umsatz

Zeigt die gewichtete CO_2-Intensität je 1 Mio. USD Umsatz und wendet einen gewichteten Durchschnitt auf die Emissionsintensität der Bestände an.

THG-Intensität Scope 1+2

Fonds	**2.509**
Vergleichsgruppe	**7.271**

7.300
tCO_2e/Mio. USD Umsatz

Umfasst direkte Treibhausgasemissionen aus dem eigenen Geschäftsbetrieb (Scope 1) sowie indirekte Emissionen aus eingekaufter Energie wie Strom oder Wärme (Scope 2). Die Kennzahl zeigt, wie viele Emissionen für 1 Mio. USD Umsatz anfallen.

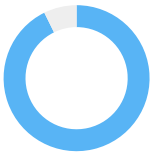
THG-Intensität Scope 1+2+3

Fonds	**40.106**
Vergleichsgruppe	**110.253**

110.300
tCO_2e/Mio. USD Umsatz

Erweitert Scope 1+2 um vor- und nachgelagerte Treibhausgasemissionen entlang der Wertschöpfungskette (Scope 3), z. B. aus Lieferketten, Transport und Produktnutzung. Damit wird der gesamte Klimafußabdruck pro 1 Mio. USD Umsatz sichtbar.

Anteil der Emissionen offenliegender Positionen (nach Gewicht)



92,71 %

Zeigt den Abdeckungsgrad des Fonds-Portfolios basierend auf den Gewichten der Positionen, für die Emissionsdaten aus Nachhaltigkeits- oder Geschäftsberichten, CDP-Offenlegungen oder anderen verifizierten Quellen vorliegen.

ISS STOXX

*Alle Rechte an den von Institutional Shareholder Services Inc. und ihren verbundenen Unternehmen (ISS STOXX) bereitgestellten Informationen liegen bei ISS STOXX und/oder ihren Lizenzgebern. ISS STOXX übernimmt keinerlei ausdrückliche oder stillschweigende Gewährleistungen irgendeiner Art und haftet nicht für Fehler, Auslassungen oder Unterbrechungen in oder im Zusammenhang mit den von ISS STOXX bereitgestellten Daten.
Weitere Informationen zur Methodologie und Berechnung der ESG-Metriken finden Sie unter: Methodology Library | ISS STOXX

Glossar

SDG (Sustainable Development Goals) - Die 17 Nachhaltigkeitsziele der Vereinten Nationen, z. B. zu Klima, Gesundheit, Bildung und verantwortungsvollem Konsum.

SDG-Impact-Bewertung - Kennzahl für den aggregierten Beitrag eines Portfolios zu den SDGs. Die Skala reicht von -10 (deutlich negativ) bis +10 (deutlich positiv).

SDG-Abdeckungsquote - Anteil des Fondsportfolios, der den UN-Nachhaltigkeitszielen (SDGs) zugeordnet werden kann.

CDP - eine globale gemeinnützige Organisation, die das weltweit einzige unabhängige Umweltoffenlegungssystem betreibt. CDP-Offenlegungen sind freiwillige Umweltberichte, die von Unternehmen, Städten und Regierungen bei CDP (ehemals Carbon Disclosure Project) eingereicht werden.

Lipper Global Classification (LGC) System - Klassifizierungssystem zur Einteilung von Fonds in homogene Gruppen mit vergleichbaren Anlagezielen und Marktsegmenten. Fonds innerhalb eines LGC-Sektors können jedoch unterschiedliche Anlagestrategien oder -stile verfolgen, um ihre Anlageziele zu erreichen.

ESG-Kriterien - Kriterien zur Bewertung der Nachhaltigkeit von Unternehmen und Fonds unter Berücksichtigung von Umwelt-, Sozial- und Governance-Aspekten.