

BlackRock Strategic Funds

PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ (NON RÉVISÉE) (suite)

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.



Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Dénomination du produit :
BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate

Identifiant d'entité juridique :
2221005JLXKBTXTSV51

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promouvait des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et, bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___% d'investissements durables

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promouvait des caractéristiques E/S, mais n'a pas réalisé d'investissements durables**

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

Le tableau suivant liste les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds pendant la période de référence. Le prospectus du Fonds contient de plus amples informations sur ces caractéristiques environnementales et sociales. Veuillez consulter la section « Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ? » ci-dessous pour obtenir des renseignements sur la mesure dans laquelle le Fonds a répondu à ces caractéristiques environnementales et sociales.

Caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds

Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif, ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG ou composés d'obligations émises par des gouvernements qui ont une notation souveraine ESG d'au moins BB (défini par des fournisseurs de données ESG tiers) et, dans les deux cas, sont des OPC dont le statut est conforme au Règlement SFDR

Amélioration du score ESG ajusté par rapport au MSCI All Country World Index et au Bloomberg Multiverse Index

Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenu de ventes de détections du Fonds) de 30 % par rapport au MSCI All Country World Index et au Bloomberg Multiverse Index

Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG

BlackRock Strategic Funds

PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ (NON RÉVISÉE) (suite)

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

● Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur la performance des indicateurs de développement durable utilisés pour mesurer la réalisation de chacune des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds, comme davantage détaillé dans le prospectus du Fonds.

| Indicateur de durabilité | Élément de mesure | Performance pour la période de référence |
|--|---|--|
| Détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents qui poursuivent un objectif ou un résultat ESG positif, ou, dans le cas d'expositions à des obligations d'État, suivent des indices de référence intégrant des exigences ESG ou composés d'obligations émises par des gouvernements qui ont une notation souveraine ESG d'au moins BB (défini par des fournisseurs de données ESG tiers) et, dans les deux cas, sont des OPC dont le statut est conforme au Règlement SFDR | % de détentions d'organismes de placement collectif sous-jacents | 90,32 % |
| Amélioration du score ESG ajusté par rapport au MSCI All Country World Index et au Bloomberg Multiverse Index | % d'amélioration du score ESG par rapport à l'indice de référence | 2,58 % |
| Contrôle du fait que plus de 90 % des émetteurs de titres dans lesquels le Fonds investit (en dehors des fonds monétaires) sont notés ESG ou ont été analysés aux fins des critères ESG | % d'émetteurs notés ESG | Plus de 90 % des émetteurs |
| Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détentions du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index et au Bloomberg Multiverse Index de 30 % | % de réduction de l'intensité des émissions carbone par rapport à l'indice de référence | 35,35 % |

● ...et par rapport aux périodes précédentes ?

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.

● Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables effectués y ont-ils contribué ?

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

BlackRock Strategic Funds

PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ (NON RÉVISÉE) (suite)

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

- **Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables. Veuillez consulter la section « Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ? » ci-dessous qui décrit comment le Fonds tient compte des PIN sur les facteurs de développement durable.

- **Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE. Elle s'accompagne de critères propres à l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Le tableau suivant fournit des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable prises en compte par ce Fonds. Le Fonds a pris en compte les principales incidences négatives sur les facteurs de développement durable en appliquant ces critères ESG et d'exclusion minimaux. Le Conseiller en investissements a indiqué que les PIN figurant dans le tableau ci-dessous comme « E » sont entièrement prises en compte et que celles marquées « P » sont en partie prises en compte dans les critères de sélection des investissements. Une PIN est partiellement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond partiellement à la définition réglementaire de PIN présentée à l'Annexe 1 au Règlement (UE) 2019/2088 Normes techniques de réglementation (« RTS »). Une PIN est entièrement prise en compte si une évaluation interne de BlackRock a déterminé que l'indicateur de développement durable répond à la définition réglementaire complète, comme indiqué à l'Annexe 1 qui complète le Règlement (UE) 2019/2088 RTS.

| Indicateur d'incidences négatives sur la durabilité | Indicateur de durabilité | |
|---|--|---|
| | Réduction de l'intensité des émissions carbone (émissions pour 1 million USD de revenus de ventes de détections du Fonds) par rapport au MSCI All Country World Index et au Bloomberg Multiverse Index | |
| Émissions de gaz à effet de serre (GES) | | P |
| Intensité de GES des sociétés bénéficiaires des investissements | | P |

BlackRock Strategic Funds

PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ (NON RÉVISÉE) (suite)

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 1er juin 2022 au 31 mai 2023.

| Investissements les plus importants | Secteur | % d'actifs | Pays |
|---|---------|------------|---------|
| iShares MSCI Usa ESG Enhance Usdha | ETF | 14,98 % | Irlande |
| iShares Eur Govt Bond Climate UCITS | ETF | 8,86 % | Irlande |
| iShares Edge MSCI USA Minimum Usdha | ETF | 6,54 % | Irlande |
| iShares \$ Treasury Bond 1-3Yr UCITS | ETF | 6,48 % | Irlande |
| iShares \$ Corp Bond ESG UCITS Usdha | ETF | 5,00 % | Irlande |
| iShares MSCI EM ESG Enhanced Usdha | ETF | 4,97 % | Irlande |
| iSh Eur Gvt Bnd 0-1 ETF EUR Dist | ETF | 4,50 % | Irlande |
| iShares J.P. Morgan ESG \$ EM Usdha | ETF | 4,17 % | Irlande |
| iShares Physical Gold | ETC | 2,99 % | Irlande |
| iShares Euro Inflation Linked Govt Bd UCITS | ETF | 2,64 % | Irlande |
| iShares \$ High Yield Corp Bo Usdha | ETF | 2,45 % | Irlande |
| iShares \$ Treasury Bond 7-10Yr UCITS | ETF | 2,39 % | Irlande |
| iShares China CNY Bond UCITS USD HD D | ETF | 2,10 % | Irlande |
| iShares MSCI Japan ESG Enhanced Usdha | ETF | 2,00 % | Irlande |
| iShares MSCI EMU ESG Enhance Eurha | ETF | 1,95 % | Irlande |

BlackRock Strategic Funds

PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ (NON RÉVISÉE) (suite)

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (suite)

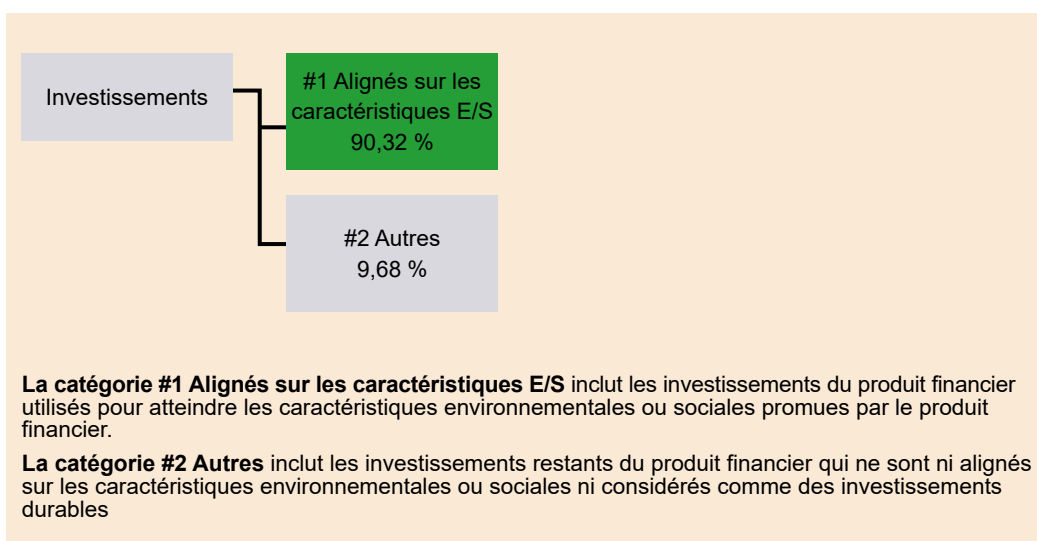
Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852



L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?



BlackRock Strategic Funds

PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ (NON RÉVISÉE) (suite)

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Le tableau suivant détaille les secteurs économiques auxquels a été exposé le Fonds pendant la période de référence.

| Secteur | Sous-secteur | % des investissements |
|-----------------------------------|---|-----------------------|
| Titres gouvernementaux | Titres gouvernementaux | 38,37 % |
| Soins de santé | Pharmacie, biotechnologie et sciences de la vie | 4,99 % |
| Finance | Banques | 4,67 % |
| Finance | Services financiers | 4,49 % |
| Technologie de l'information | Logiciels et services | 4,31 % |
| Produits industriels | Biens d'équipement | 3,73 % |
| Technologie de l'information | Matériel et équipement technologiques | 3,11 % |
| Autre | Autre | 2,99 % |
| Technologie de l'information | Semi-conducteurs et équipements de semi-conducteur | 2,65 % |
| Soins de santé | Équipement de soins de santé et services | 2,65 % |
| Communication | Médias et divertissement | 2,62 % |
| Matières premières | Matières premières | 2,54 % |
| Services aux collectivités | Services aux collectivités | 2,49 % |
| Produits de consommation courante | Nourriture Boissons Tabac | 2,46 % |
| Finance | Assurance | 2,23 % |
| Produits accessoires | Distribution et vente au détail de produits accessoires | 2,15 % |
| Communication | Télécommunications | 1,67 % |
| Produits industriels | Transports | 1,52 % |
| Immobilier | Sociétés de placement immobilier (REIT) | 1,50 % |
| Produits industriels | Services commerciaux et professionnels | 1,22 % |
| Produits accessoires | Automobiles et composants | 1,12 % |
| Énergie | Stockage et transport pétroliers et gaziers | 0,60 % |
| Énergie | Pétrole et gaz intégrés | 0,49 % |
| Énergie | Services d'équipement pétrolier et gazier | 0,34 % |
| Énergie | Raffinage et marketing pétroliers et gaziers | 0,33 % |
| Énergie | Exploration et produits pétroliers et gaziers | 0,30 % |
| Énergie | Forage pétrolier et gazier | 0,03 % |

Pour être conforme à la taxinomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin de 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi ;
- des **dépenses d'investissement** (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation** (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés dans lesquelles le produit financier a investi.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Pour la période de référence, l'alignement des investissements du Fonds sur la taxinomie de l'UE est présenté dans les graphiques ci-dessous.

Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE¹ ?

- Oui :
- Dans le gaz fossile
 - Dans l'énergie nucléaire
- Non

¹ Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement climatique ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxinomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

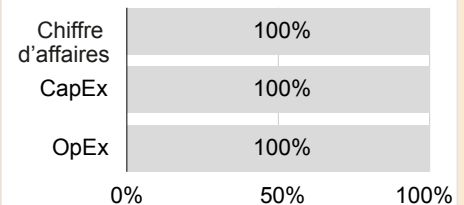
Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.

1. Alignement des investissements sur la taxinomie, dont obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

2. Alignement des investissements sur la taxinomie, hors obligations souveraines*



- Alignés sur la taxinomie: gaz fossile
- Alignés sur la taxinomie: nucléaire
- Alignés sur la taxinomie (hors gaz et nucléaire)
- Non alignés sur la taxinomie

Ce graphique représente 100,00 % des investissements totaux.

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

● **Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Sur la période de référence, 0 % des investissements du Fonds étaient réalisés dans des activités transitoires et habilitantes.

● **Comment le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE a-t-il évolué par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Comme il s'agit de la première période de référence de publication périodique d'informations pour les produits financiers visés à l'Article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du Règlement (UE) 2019/2088 et à l'Article 6, premier alinéa, du Règlement (UE) 2020/852, aucune comparaison n'a pu être établie.



Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?**

Cette section ne s'applique pas à ce Fonds, car il ne s'est pas engagé à détenir des Investissements durables pendant la période de référence. Toutefois, le portefeuille d'investissement du Fonds peut contenir certains Investissements durables.



● **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux ?**

Les investissements de la catégorie « #2 Autres » peuvent comprendre des liquidités et des instruments dérivés, mais ces détentions n'excédaient pas 20 %. Ces investissements n'ont été utilisés à des fins d'investissement que pour atteindre l'objectif d'investissement (non ESG) du Fonds, à des fins de gestion de la liquidité et/ou de couverture.

Le Fonds ne détenait aucun autre investissement évalué par rapport aux garanties environnementales ou sociales minimales.



● **Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?**

Le Conseiller en investissements a mis en place des contrôles de qualité internes, comme une codification des règles de conformité, pour garantir le respect des caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds. Le Conseiller en investissements contrôle régulièrement les caractéristiques environnementales et sociales promues par le Fonds afin de s'assurer qu'elles correspondent toujours à l'univers d'investissement du Fonds.

Si des émetteurs sont identifiés comme ayant potentiellement des problèmes de bonne gouvernance, les émetteurs sont contrôlés pour que le Conseiller en investissements, s'il est d'accord avec cette évaluation externe, s'assure que l'émetteur a pris des mesures de réparation ou qu'il en prenne dans un délai raisonnable selon l'implication directe du Conseiller en investissements avec l'émetteur. Le Conseiller en investissements peut également décider de réduire l'exposition à ces émetteurs.

BlackRock Strategic Funds

PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ (NON RÉVISÉE) (suite)

BlackRock Managed Index Portfolios – Moderate (suite)

Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 bis, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852



Les indices de référence sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promet.

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Pour la période de référence, aucun indice n'a été désigné comme indice de référence dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le Fonds, par conséquent cette section n'est pas applicable.

● En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Sans objet.

● Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?

Sans objet.