

BlackRock

Bæredygtighedsrelaterede oplysninger på websted

QMM Actively Managed US Equity Fund

Ikrafttrædelsesdato: 29. august 2025

Denne offentliggørelse på webstedet indeholder bæredygtighedsrelaterede oplysninger om fonden i henhold til artikel 10 i EU's forordning om offentliggørelse af oplysninger

A. Sammenfatning

Fonden fremmer miljømæssige og sociale karakteristika, men har ikke bæredygtige investeringer som mål. Fonden investerer delvist i bæredygtige investeringer. BlackRock definerer bæredygtige investeringer som investeringer i udstedere eller værdipapirer, som bidrager til et miljømæssigt eller socialt mål, forudsat at sådanne investeringer ikke er til væsentlig skade for nogen af disse mål, og at de virksomheder, der investeres i, følger god ledelsespraksis. BlackRock baserer sig på relevante bæredygtighedsrammer for at afdække, om investeringen er tilpasset miljømæssige eller sociale mål. Bæredygtige investeringer bør ligeledes opfylde kravene om ikke at gøre væsentlig skade (DNSH), som defineret af gældende love og bestemmelser. BlackRock har udviklet et sæt kriterier med det formål at vurdere, hvorvidt en udsteder eller investering påfører væsentlig skade. Fonden søger at: anvende et sæt udelukkelsesscreeninger.

Fonden tilstræber at opnå bedre resultater end MSCI USA ESG Ex Select Business Involvement Screens Index over en rullende treårig periode og samtidig søge at maksimere mulighederne og minimere de potentielle risici i forbindelse med visse ESG-temaer og -overvejelser. De bindende elementer af investeringsstrategien er følgende: 1. At fastholde mindst 20 % af fondens portefølje i bæredygtige investeringer. 2. At anvende følgende udelukkelsesscreeninger på grundlag af de miljømæssige, sociale og ledelsesmæssige (ESG) relaterede karakteristika, der er angivet nedenfor. Investeringsforvalteren søger at begrænse og/eller udelukke direkte investering (alt efter hvad der er relevant) i udstedere, som er identificeret som værende involveret i visse aktiviteter som beskrevet i nedenstående sammenfatning (involvering kan være baseret på, at udstederens aktivitet er over et vist tærskelkriterie, eller at udstederen er direkte engageret i aktiviteten), dvs. udstedere som: er engageret i eller på anden vis eksponeret for produktion af våben (herunder, men ikke begrænset til, civile våben, civile håndvåben, klyngeammunition, antipersonelminer, hvidt fosfor anvendt i brandvåben eller ammunition, forarmet uranvåben, biologiske, kemiske og atomvåben). 1) er engageret i tobaksproduktion, 2) har mere end: 5 % af indtægter fra distribution eller levering af håndvåben i detailledet, (i) 5 % af indtægter fra termisk kuludvinding eller elproduktion, (ii) 5 % af indtægter fra produktion af olietjæresand (også kendt som oliesand), (iii) 5 % af indtægter fra olie- og gasproduktion eller 25 % af indtægter fra levering af visse tjenesteydelser tilknyttet olie og gas, (iv) 5 % af indtægter fra distribution og salg af tobaksprodukter samt levering af visse tobaksrelaterede produkter, (v) 25 % af indtægter fra fremstillingen af alkohol eller 25 % af indtægter fra salg og levering af visse alkoholrelaterede produkter, (vi) 5 % af indtægter fra udviklingen eller 15 % af indtægter fra dyrkningen af genetisk manipulerede planter og andre organismer, der er beregnet til brug i landbruget eller som menneskeføde, (vii) 5 % af indtægter fra driften af spilrelaterede aktiviteter eller 15 % af indtægter fra produkter, tjenesteydelser, udstyr eller anlæg relateret til hasardspil, (viii) 5 % af indtægter fra produktionen eller 15 % af indtægter fra distributionen af voksenunderholdningsmaterialer, (ix) har været angivet som involveret i en eller flere alvorlige kontroverser ifølge MSCI ESG-kontroverser i forbindelse med: (i) biodiversitet og arealanvendelse, (ii) vandstress, (iii) driftsaffald (ikke farligt) og (iv) giftige udledninger og affald. Fonden overvejer de vigtigste negative indvirkninger på bæredygtighedsfaktorer gennem anvendelse af udelukkelsespolitikken.

Mindst 85 % af fondens samlede aktiver placeres i investeringer, der er tilpasset de miljømæssige og/eller sociale karakteristika. Af disse investeringer vil mindst 20 % af fondens samlede aktiver blive placeret i bæredygtige investeringer, og den resterende del vil blive placeret i investeringer, der er tilpasset andre

miljømæssige og/eller sociale karakteristika. Fonden kan placere op til 15% af sine samlede aktiver i andre investeringer. Fonden forpligter sig aktuelt ikke til at placere mere end 0 % af aktiverne i bæredygtige investeringer med et miljømæssigt sigte, der er i overensstemmelse med EU's klassificeringssystem.

Fonden forpligter sig aktuelt ikke til at investere i aktiviteter relateret til fossile gasser og/eller atomenergi, der overholder EU's klassificeringssystem.

BlackRock har udviklet en højt automatiseret overholdelsesproces, der bidrager til at sikre, at fonden administreres i overensstemmelse med de angivne retningslinjer og gældende lovkrav. Det omfatter overvågning af fondens miljømæssige eller sociale karakteristika ifølge den relevante metode. BlackRock har en egenudviklet metode til at fastsætte bæredygtige investeringer, og fonden anvender en række øvrige metoder til at måle, hvordan de sociale eller miljømæssige karakteristika, som fonden fremmer, opfyldes.

BlackRocks porteføljeforvaltere har adgang til analyser, data, systemer og analytiske funktioner med henblik på at integrere ESG-indsigt i investeringsprocessen. ESG-datasæt fremskaffes fra eksterne tredjepartsdataleverandører, inklusive fra, men ikke begrænset til, MSCI, Sustainalytics, Refinitiv, S&P og Clarity AI. BlackRock anvender en omfattende due diligence-proces for at evaluere leverandørtilbud med meget målrettede gennemgange af metoden og dækningsvurdering baseret på produktets strategi for bæredygtige investeringer. Data og herunder ESG-data, som modtages via vores nuværende grænseflader, og som behandles og kontrolleres for kvalitet og fuldstændighed for at sikre, at data er af høj kvalitet, før de anvendes videre i BlackRocks systemer og applikationer såsom Aladdin. BlackRock tilstræber at registrere så mange indberettede og godkendte data fra selskaber via tredjepartsdataleverandører, som det er praktisk muligt. Dog udvikler branchens standarder sig løbende med hensyn til oplysningsrammer, navnlig hvad angår fremadskuende indikatorer. Vi gør derfor i visse tilfælde brug af skøn eller referenceforanstaltninger fra dataleverandører til at dække vores brede investeringsunivers af udstedere.

BlackRock overvåger løbende udviklingen i EU's fortsatte implementering af rammerne for bæredygtig investering og investeringsmetoderne med henblik på tilpasning til de regulatoriske miljømæssige ændringer. ESG-datasæt ændres og forbedres løbende i takt med, at ændringerne i oplysningsstandarder, regulatoriske rammer og branchens praksis udvikler sig. BlackRock samarbejder løbende med en lang række markedsdeltagere om at forbedre datakvaliteten. Bæredygtig investering og forståelse af bæredygtighed udvikler sig sammen med datamiljøet. Industrideltagere står over for udfordringer i identificeringen af et enkelt parameter eller en række standardparametre med henblik på at opnå et samlet overblik over et selskab eller en investering. BlackRock har derfor indført rammer til at identificere bæredygtige investeringer.

BlackRock anvender en høj due diligence-standard i udvælgelsen og den løbende overvågning af de investeringer, som fonden foretager, for derved at opfylde fondens retningslinjer for investering, likviditet og risiko samt bæredygtighedsrisiko, ESG-kriterier og den generelle resultatudvikling.

Samarbejde med selskaber, hvor vi investerer vores kunders aktiver, opstår på forskellige niveauer i BlackRock. Hvor investeringsteams vælger at søge kontakt, kan denne kontakt antage en lang række former, men i bund og grund vil porteføljestyringsteamet søge at føre en løbende og fortsat dialog med ledende medarbejdere eller bestyrelsesmedlemmer i engagerede investeringsmodtagende selskaber for at fremme en sund ledelseskultur og bæredygtig forretningspraksis rettet mod de identificerede ESG-karakteristika og vigtige negative indikatorer, samt for at få en forståelse af effektiviteten af selskabets håndtering af og overblik over aktiviteter, der er beregnet til at håndtere de identificerede ESG-

problematikker. Kontakten giver også porteføljestyringsteamet mulighed for at komme med feedback om selskabets praksisser og offentliggørelser.

Der er ikke noget specifikt indeks, der er beregnet som referencebenchmark for at bestemme, om fonden er tilpasset de miljømæssige og/eller sociale karakteristika, som den fremmer.

This website disclosure (“Disclosure”) is for distribution to Professional Clients (as defined by the FCA or MiFID rules) and Qualified Investors only and should not be relied upon by any other persons.

Issued by BlackRock Asset Management (Ireland) Ltd., authorised and regulated by the Central Bank of Ireland. Registered office: 2 Ballsbridge Park, Dublin, D04 YW83, Ireland. The registered number is 227552. For more information, please see the website: www.blackrock.com. For your protection telephone calls are usually recorded. BlackRock is a trading name of BlackRock Asset Management (Ireland) Ltd.

The information contained herein, is proprietary in nature and has been provided to you on a confidential basis and may only be distributed without the prior consent of BlackRock to (i) your affiliates, and (ii) your professional advisers, provided that they are subject to a duty of confidentiality.

This Disclosure is for information purposes only and does not constitute an offer or invitation to anyone to invest in any BlackRock funds or products and has not been prepared in connection with any such offer.

The information and opinions contained in this Disclosure are derived from proprietary and non-proprietary sources deemed by BlackRock to be reliable, are not necessarily all-inclusive and are not guaranteed as to accuracy. As such, no warranty of accuracy or reliability is given and no responsibility arising in any other way for errors and omissions (including responsibility to any person by reason of negligence) is accepted by BlackRock, its officers, employees or agents.

This Disclosure is provided for the information of its intended recipient and BlackRock expressly disclaims any liability which may result from any use of this information, including, but not limited to, its use in the preparation of financial reports or other disclosures.

Capital at risk. The value of investments and the income from them can fall as well as rise and is not guaranteed. You may not get back the amount originally invested. Changes in the rates of exchange between currencies may cause the value of investments to diminish or increase. Fluctuation may be particularly marked in the case of a higher volatility fund and the value of an investment may fall suddenly and substantially. Levels and basis of taxation may change from time to time.

Any research in this Disclosure has been procured and may have been acted on by BlackRock for its own purpose. The results of such research are being made available only incidentally. The views expressed do not constitute investment or any other advice and are subject to change. They do not necessarily reflect the views of any company in the BlackRock Group or any part thereof and no assurances are made as to their accuracy.

© 2024 BlackRock, Inc. All Rights reserved. BLACKROCK, BLACKROCK SOLUTIONS, iSHARES, BUILD ON BLACKROCK and SO WHAT DO I DO WITH MY MONEY are trademarks of BlackRock, Inc. or its subsidiaries in the United States and elsewhere. All other trademarks are those of their respective owners.